

CMS1：内部モデルを用いた手法と標準的手法のリスク・アセットの比較

項番		イ	ロ	ハ	ニ
		リスク・アセットの額			
		内部モデルを用いて算出した リスク・アセットの額	標準的な手法適用分の リスク・アセットの額	リスク・アセットの額	資本フロア計算に用いられる、 標準的な手法により算出した リスク・アセットの額 (フロア掛目前)
1	信用リスク	53,648,382	9,383,760	63,032,142	119,238,630
2	カウンターパーティ信用リスク	2,055,901	831,678	2,887,579	6,218,532
3	CVAリスク		2,806,729	2,806,729	2,806,729
4	信用リスク・アセットの額の算出 対象となっている証券化エクス ポージャー	1,423,702	291,223	1,714,925	2,543,111
5	マーケット・リスク		4,020,564	4,020,564	4,020,564
6	オペレーショナル・リスク		6,166,393	6,166,393	6,166,393
7	その他リスク・アセット		13,428,777	13,428,777	10,968,733
8	合計	57,127,986	36,929,127	94,057,113	151,962,696