

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	55,252,555	10,244,241	65,496,796	124,101,373
2	カウンターパーティ信用リスク	2,484,551	991,022	3,475,574	7,056,597
3	CVAリスク		3,082,162	3,082,162	3,082,162
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	1,661,378	307,890	1,969,269	2,879,813
5	マーケット・リスク		3,977,794	3,977,794	3,977,794
6	オペレーションナル・リスク		6,737,778	6,737,778	6,737,778
7	その他リスク・アセット		14,106,753	14,106,753	11,276,523
8	合計	59,398,485	39,447,643	98,846,128	159,112,042