

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	51,939,001	12,484,691	64,423,692	120,906,421
2	カウンターパーティ信用リスク	2,616,349	1,071,768	3,688,117	6,975,413
3	CVAリスク		3,159,867	3,159,867	3,159,867
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	2,336,864	1,029,553	3,366,417	4,332,583
5	マーケット・リスク	—	5,331,585	5,331,585	5,331,585
6	オペレーショナル・リスク		7,384,012	7,384,012	7,384,012
7	その他リスク・アセット		14,774,484	14,774,484	11,882,035
8	合計	56,892,215	45,235,962	102,128,178	159,971,919