

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（2025年6月末）

【連結】

(単位:百万円)

項番	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	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	3,814,201	643,660	4,457,862	8,931,609
2	カウンターパーティ信用リスク	39,469	1,339	40,809	84,185
3	CVAリスク		135,971	135,971	141,388
4	信用リスク・アセットの額の算出対象となっている 証券化エクスポートジャー	-	66,718	66,718	66,718
5	マーケット・リスク	-	579	579	579
6	オペレーションル・リスク		209,364	209,364	209,364
7	その他リスク・アセット		1,091,629	1,091,629	769,439
8	合計	3,853,671	2,149,263	6,002,935	10,203,284

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（2025年6月末）

【連結】

（単位:百万円）

項番	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	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	3,762,796	634,325	4,397,122	8,872,238
2	カウンターパーティ信用リスク	39,469	1,339	40,809	84,185
3	CVAリスク		135,971	135,971	141,388
4	信用リスク・アセットの額の算出対象となっている 証券化エクスポートジャー	-	66,718	66,718	66,718
5	マーケット・リスク	-	475	475	475
6	オペレーションナル・リスク		190,066	190,066	190,066
7	その他リスク・アセット		1,011,119	1,011,119	681,617
8	合計	3,802,266	2,040,016	5,842,283	10,036,690