

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9月末）

【連結】

（単位：百万円）

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	3,894,237	704,468	4,598,706	9,159,180
2	カウンターパーティ信用リスク	35,978	1,415	37,394	75,966
3	CVAリスク		125,397	125,397	130,214
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	－	68,356	68,356	68,356
5	マーケット・リスク	－	719	719	719
6	オペレーショナル・リスク		216,484	216,484	216,484
7	その他リスク・アセット		1,116,671	1,116,671	794,450
8	合計	3,930,215	2,233,512	6,163,728	10,445,372

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9月末）

【連結】(単位:百万円)

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	3,844,678	694,929	4,539,608	9,097,408
2	カウンターパーティ信用リスク	35,978	1,415	37,394	75,966
3	CVAリスク		125,397	125,397	130,214
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	-	68,356	68,356	68,356
5	マーケット・リスク	-	711	711	711
6	オペレーショナル・リスク		198,505	198,505	198,505
7	その他リスク・アセット		1,037,080	1,037,080	706,596
8	合計	3,880,656	2,126,396	6,007,052	10,277,759