

## 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（2026年3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	4,090,658	808,416	4,899,074	9,445,761
2	カウンターパーティ信用リスク	31,990	1,915	33,905	67,003
3	CVAリスク		110,086	110,086	113,629
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	-	81,274	81,274	81,274
5	マーケット・リスク	-	876	876	876
6	オペレーショナル・リスク		234,575	234,575	234,575
7	その他リスク・アセット		1,197,277	1,197,277	917,925
8	合計	4,122,648	2,434,422	6,557,071	10,861,046

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（2026年3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	4,035,483	799,422	4,834,906	9,382,184
2	カウンターパーティ信用リスク	31,990	1,915	33,905	67,003
3	CVAリスク		110,086	110,086	113,629
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	-	81,274	81,274	81,274
5	マーケット・リスク	-	893	893	893
6	オペレーショナル・リスク		209,636	209,636	209,636
7	その他リスク・アセット		1,115,969	1,115,969	825,702
8	合計	4,067,473	2,319,197	6,386,671	10,680,324