

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6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	4,096,825	910,995	5,007,820	9,636,807
2	カウンターパーティ信用リスク	30,822	1,867	32,690	65,903
3	CVAリスク		102,995	102,995	106,756
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	-	81,302	81,302	81,302
5	マーケット・リスク	-	2,443	2,443	2,443
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		1,238,425	1,238,425	965,287
8	合計	4,127,647	2,572,605	6,700,252	11,093,076

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6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	4,063,126	862,517	4,925,643	9,581,942
2	カウンターパーティ信用リスク	30,822	1,867	32,690	65,903
3	CVAリスク		102,995	102,995	106,757
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	-	81,302	81,302	81,302
5	マーケット・リスク	-	2,285	2,285	2,285
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		1,138,042	1,138,042	852,204
8	合計	4,093,948	2,398,648	6,492,597	10,900,032