

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）

（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	5,140,272	448,856	5,589,128	10,855,051
2	カウンターパーティ信用リスク	19,373	6,260	25,633	39,297
3	CVAリスク		73,550	73,550	73,550
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	-	-	-	-
5	マーケット・リスク	-	87,260	87,260	87,260
6	オペレーショナル・リスク		271,673	271,673	271,673
7	その他リスク・アセット		1,733,564	1,733,564	1,090,712
8	合計	5,159,646	2,621,166	7,780,812	12,417,546