

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）

（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	5,167,632	452,259	5,619,891	11,039,216
2	カウンターパーティ信用リスク	18,730	10,145	28,876	40,983
3	CVAリスク		74,302	74,302	74,302
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	-	66,890	66,890	66,890
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		1,576,040	1,576,040	984,766
8	合計	5,186,362	2,451,311	7,637,674	12,477,832