

■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(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	1,125,287	605,390	1,730,678	2,528,641
2	カウンターパーティ信用リスク	5,951	—	5,951	9,975
3	CVAリスク		62,155	62,155	62,155
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	—	29,108	29,108	29,108
5	マーケット・リスク	—	—	—	—
6	オペレーショナル・リスク		71,148	71,148	71,148
7	その他リスク・アセット		197,023	197,023	173,684
8	合計	1,131,239	964,827	2,096,066	2,874,714