

■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	1,146,606	591,927	1,738,533	2,558,222
2	カウンターパーティ信用リスク	6,539	—	6,539	10,574
3	CVAリスク		68,258	68,258	68,258
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	—	28,320	28,320	28,320
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		192,118	192,118	162,403
8	合計	1,153,145	951,773	2,104,919	2,898,927