

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(2024年3月期)

【三井住友信託銀行】

(連結・国際統一基準)

(単位:百万円)

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	14,170,220	512,447	14,682,668	25,774,983
2	カウンターパーティ信用リスク	428,017	28,865	456,883	995,074
3	CVAリスク		512,063	512,063	512,063
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	411,818	26,644	438,462	1,075,184
5	マーケット・リスク	—	990,531	990,531	990,531
6	オペレーショナル・リスク		1,060,031	1,060,031	1,060,031
7	その他リスク・アセット		4,933,733	4,933,733	3,100,742
8	合計	15,010,056	8,064,317	23,074,373	33,508,611