

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(2025年3月期第3四半期)

【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	13,526,614	539,857	14,066,472	25,197,259
2	カウンターパーティ信用リスク	398,817	45,691	444,509	887,325
3	CVAリスク		484,614	484,614	484,614
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	400,157	30,875	431,033	750,336
5	マーケット・リスク	—	1,008,692	1,008,692	1,008,692
6	オペレーショナル・リスク		1,237,876	1,237,876	1,237,876
7	その他リスク・アセット		5,126,413	5,126,413	3,044,300
8	合計	14,325,589	8,474,022	22,799,612	32,610,405