

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)

【三井住友トラストグループ】

(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	584,726	14,111,340	25,242,127
2	カウンターパーティ信用リスク	398,817	47,991	446,808	889,624
3	CVAリスク		475,197	475,197	475,197
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	—	1,015,982	1,015,982	1,015,982
6	オペレーショナル・リスク		1,511,525	1,511,525	1,511,525
7	その他リスク・アセット		5,446,485	5,446,485	3,362,209
8	合計	14,325,589	9,112,784	23,438,374	33,247,005