

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)

【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	12,180,174	1,581,342	13,761,517	24,905,687
2	カウンターパーティ信用リスク	337,212	55,933	393,146	755,163
3	CVAリスク		412,168	412,168	412,168
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	341,463	29,499	370,963	683,730
5	マーケット・リスク	—	1,221,742	1,221,742	1,221,742
6	オペレーショナル・リスク		1,284,217	1,284,217	1,284,217
7	その他リスク・アセット		5,023,596	5,023,596	3,146,206
8	合計	12,858,850	9,608,502	22,467,352	32,408,916