

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	12,180,174	1,628,756	13,808,931	24,953,101
2	カウンターパーティ信用リスク	337,212	58,037	395,249	757,267
3	CVAリスク		412,925	412,925	412,925
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	—	1,229,165	1,229,165	1,229,165
6	オペレーショナル・リスク		1,562,148	1,562,148	1,562,148
7	その他リスク・アセット		5,353,389	5,353,389	3,474,264
8	合計	12,858,850	10,273,924	23,132,774	33,072,603