

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6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	11,696,242	1,597,081	13,293,324	24,308,758
2	カウンターパーティ信用リスク	310,230	47,955	358,185	645,864
3	CVAリスク		316,692	316,692	316,692
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	428,662	25,152	453,815	709,282
5	マーケット・リスク	—	1,196,765	1,196,765	1,196,765
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		5,079,438	5,079,438	3,183,871
8	合計	12,435,136	9,547,303	21,982,439	31,645,452