

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	11,696,242	1,637,979	13,334,222	24,349,657
2	カウンターパーティ信用リスク	310,230	49,796	360,027	647,706
3	CVAリスク		317,338	317,338	317,338
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	—	1,202,677	1,202,677	1,202,677
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		5,412,668	5,412,668	3,515,369
8	合計	12,435,136	10,207,762	22,642,898	32,304,179