

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9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	11,923,473	1,682,328	13,605,801	24,867,987
2	カウンターパーティ信用リスク	370,174	52,655	422,829	917,121
3	CVAリスク		397,270	397,270	397,270
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	391,905	22,958	414,864	741,655
5	マーケット・リスク	—	1,137,375	1,137,375	1,137,375
6	オペレーショナル・リスク		1,412,136	1,412,136	1,412,136
7	その他リスク・アセット		5,410,709	5,410,709	3,331,969
8	合計	12,685,552	10,115,433	22,800,986	32,805,516