

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12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 | 12,692,726 | 1,694,911 | 14,387,637 | 25,944,291 |
| 2 | カウンターパーティ信用リスク | 452,099 | 51,668 | 503,768 | 1,301,092 |
| 3 | CVAリスク | | 443,132 | 443,132 | 443,132 |
| 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 | 503,083 | 27,935 | 531,019 | 795,134 |
| 5 | マーケット・リスク | — | 1,066,499 | 1,066,499 | 1,066,499 |
| 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 | | 5,909,246 | 5,909,246 | 3,683,851 |
| 8 | 合計 | 13,647,909 | 10,605,530 | 24,253,440 | 34,646,138 |