

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	二
		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	オペレーションナル・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