

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	12,692,726	1,744,638	14,437,364	25,994,018
2	カウンターパーティ信用リスク	452,099	53,884	505,983	1,303,308
3	CVAリスク		443,940	443,940	443,940
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	—	1,075,870	1,075,870	1,075,870
6	オペレーショナル・リスク		1,689,907	1,689,907	1,689,907
7	その他リスク・アセット		6,258,090	6,258,090	4,030,963
8	合計	13,647,909	11,294,267	24,942,176	35,333,143