

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(2026年3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 | 12,926,594 | 1,933,873 | 14,860,467 | 26,535,671 |
| 2 | カウンターパーティ信用リスク | 423,130 | 69,680 | 492,811 | 1,313,125 |
| 3 | CVAリスク | | 410,521 | 410,521 | 410,521 |
| 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 | 543,569 | 26,206 | 569,775 | 781,308 |
| 5 | マーケット・リスク | — | 1,135,422 | 1,135,422 | 1,135,422 |
| 6 | オペレーショナル・リスク | | 1,481,205 | 1,481,205 | 1,481,205 |
| 7 | その他リスク・アセット | | 6,095,047 | 6,095,047 | 4,046,269 |
| 8 | 合計 | 13,893,294 | 11,151,957 | 25,045,251 | 35,703,524 |