

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	12,926,594	1,982,757	14,909,351	26,584,555
2	カウンターパーティ信用リスク	423,130	73,257	496,387	1,316,702
3	CVAリスク		411,733	411,733	411,733
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	—	1,146,580	1,146,580	1,146,580
6	オペレーショナル・リスク		1,765,073	1,765,073	1,765,073
7	その他リスク・アセット		6,495,464	6,495,464	4,445,146
8	合計	13,893,294	11,901,073	25,794,367	36,451,100