

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6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	13,091,361	2,093,421	15,184,782	26,895,087
2	カウンターパーティ信用リスク	379,526	74,014	453,540	1,126,536
3	CVAリスク		388,371	388,371	388,371
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	638,732	24,871	663,604	887,093
5	マーケット・リスク	—	952,733	952,733	952,733
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		6,467,030	6,467,030	4,376,536
8	合計	14,109,619	11,481,647	25,591,267	36,107,563