

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	13,091,361	2,143,909	15,235,270	26,945,575
2	カウンターパーティ信用リスク	379,526	77,107	456,633	1,129,629
3	CVAリスク		389,406	389,406	389,406
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	—	958,127	958,127	958,127
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		6,828,459	6,828,459	4,736,425
8	合計	14,109,619	12,186,956	26,296,576	36,811,332