

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(2024年3月期)

【三井住友トラスト・ホールディングス】

(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	14,170,220	555,733	14,725,954	25,818,269
2	カウンターパーティ信用リスク	428,017	30,549	458,567	996,758
3	CVAリスク		512,641	512,641	512,641
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	411,818	26,644	438,462	1,075,184
5	マーケット・リスク	—	1,006,275	1,006,275	1,006,275
6	オペレーショナル・リスク		1,352,426	1,352,426	1,352,426
7	その他リスク・アセット		5,236,683	5,236,683	3,401,529
8	合計	15,010,056	8,720,954	23,731,010	34,163,086