

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(2025年3月期第1四半期)

【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	14,106,348	536,435	14,642,783	25,771,807
2	カウンターパーティ信用リスク	499,413	44,945	544,359	1,406,471
3	CVAリスク		589,328	589,328	589,328
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	520,978	40,794	561,772	776,172
5	マーケット・リスク	—	1,147,214	1,147,214	1,147,214
6	オペレーショナル・リスク		1,060,031	1,060,031	1,060,031
7	その他リスク・アセット		5,045,573	5,045,573	3,070,795
8	合計	15,126,739	8,464,323	23,591,062	33,821,820