

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	14,106,348	574,902	14,681,250	25,810,274
2	カウンターパーティ信用リスク	499,413	46,844	546,258	1,408,370
3	CVAリスク		575,970	575,970	575,970
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	—	1,152,699	1,152,699	1,152,699
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		5,403,412	5,403,412	3,426,472
8	合計	15,126,739	9,147,049	24,273,789	34,502,385