

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2四半期)

【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	13,260,691	541,451	13,802,142	24,510,065
2	カウンターパーティ信用リスク	363,546	42,744	406,290	613,107
3	CVAリスク		465,680	465,680	465,680
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	432,277	25,776	458,053	737,702
5	マーケット・リスク	—	1,023,431	1,023,431	1,023,431
6	オペレーショナル・リスク		1,237,876	1,237,876	1,237,876
7	その他リスク・アセット		4,802,405	4,802,405	2,945,736
8	合計	14,056,515	8,139,364	22,195,880	31,533,599