

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	13,260,691	579,217	13,839,909	24,547,832
2	カウンターパーティ信用リスク	363,546	44,825	408,372	615,188
3	CVAリスク		466,471	466,471	466,471
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	—	1,032,409	1,032,409	1,032,409
6	オペレーショナル・リスク		1,511,525	1,511,525	1,511,525
7	その他リスク・アセット		5,150,608	5,150,608	3,291,777
8	合計	14,056,515	8,810,834	22,867,349	32,202,907