

リスク・アセットの概要(2024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)

OV1:リスク・アセットの概要					
国際様式の 該当番号		イ	ロ	ハ	ニ
		リスク・アセット		所要自己資本	
		2023年6月末	2023年3月末	2023年6月末	2023年3月末
1	信用リスク	13,969,064	13,526,356	1,177,192	1,140,774
2	うち、標準的手法適用分	524,345	556,708	41,947	44,536
3	うち、内部格付手法適用分	12,430,785	12,222,112	1,054,130	1,036,435
	うち、重要な出資のエクスポージャー	-	-	-	-
	うち、リース取引における見積残存価額のエクスポージャー	282,065	138,902	22,565	11,112
	その他	731,867	608,633	58,549	48,690
4	カウンターパーティ信用リスク	1,332,840	1,234,786	108,802	100,644
5	うち、SA-CCR適用分	-	-	-	-
	うち、カレント・エクスポージャー方式適用分	438,506	375,435	37,163	31,818
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	681,344	644,470	54,507	51,557
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	62,007	76,398	4,960	6,111
	その他	150,982	138,481	12,171	11,156
7	マーケット・ベース方式に基づく株式等エクスポージャー	366,520	301,987	31,080	25,608
8	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算(ルック・スルー方式)	2,013,724	1,987,217	161,097	158,977
9	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算(マンドート方式)	1,783,210	1,669,856	142,656	133,588
	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算(蓋然性方式250%)	-	-	-	-
	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算(蓋然性方式400%)	-	-	-	-
10	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算(フォールバック方式1,250%)	1,247	1,311	99	104
11	未決済取引	-	-	-	-
12	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	345,492	320,847	27,639	25,667
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	329,183	303,454	26,334	24,276
14	うち、外部格付準拠方式適用分	16,188	17,232	1,295	1,378
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	-	-	-	-
	うち、1,250%のリスク・ウェイト適用分	119	160	9	12
16	マーケット・リスク	1,607,871	1,838,234	128,629	147,058
17	うち、標準的方式適用分	93,252	82,169	7,460	6,573
18	うち、内部モデル方式適用分	1,514,618	1,756,065	121,169	140,485
19	オペレーショナル・リスク	1,006,720	1,006,720	80,537	80,537
20	うち、基礎的手法適用分	219,688	219,688	17,575	17,575
21	うち、粗利益配分手法適用分	-	-	-	-
22	うち、先進的計測手法適用分	787,031	787,031	62,962	62,962
23	特定項目のうち、調整項目に算入されない部分に係るエクスポージャー	509,080	561,184	43,170	47,588
	経過措置によりリスク・アセットの額に算入されるものの額	-	-	-	-
24	フロア調整	-	-	-	-
25	合計 (スケールリングファクター適用後)*	23,761,343	23,256,895	1,900,907	1,860,551

* 項番25のリスク・アセットのみスケールリングファクターを適用した値を記載しております。