

リスク・アセットの概要(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)

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	
		2024年6月末	2024年3月末	2024年6月末	2024年3月末
1	信用リスク	15,598,903	15,861,133	1,247,912	1,268,890
2	うち、標準的手法適用分	574,902	555,733	45,992	44,458
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	10,704,553	10,858,672	856,364	868,693
4	うち、スロットティング・クライテリア適用分	834,808	799,142	66,784	63,931
5	うち、先進的内部格付手法適用分	2,566,985	2,512,404	205,358	200,992
	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	326,735	295,966	26,138	23,677
	その他	590,918	839,212	47,273	67,136
6	カウンターパーティ信用リスク	546,258	458,567	43,700	36,685
7	うち、SA-CCR適用分	488,825	419,098	39,106	33,527
8	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	25,067	7,986	2,005	638
9	その他	32,365	31,482	2,589	2,518
10	CVAリスク	575,970	512,641	46,077	41,011
	うち、SA-CVA適用分	—	—	—	—
	うち、完全なBA-CVA適用分	575,970	512,641	46,077	41,011
	うち、限定的なBA-CVA適用分	—	—	—	—
11	経過措置により適用されるマーケット・ベース方式に基づく株式等エクスポージャー	460,490	426,085	36,839	34,086
12	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)	1,801,617	1,634,100	144,129	130,728
13	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)	1,676,162	1,551,123	134,092	124,089
	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%)	—	—	—	—
14	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1250%)	718	746	57	59
15	未決済取引	—	—	—	—
16	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	561,772	438,462	44,941	35,076
17	うち、内部格付手法準拠方式適用分	520,978	411,818	41,678	32,945
18	うち、外部格付準拠方式適用分又は内部評価方式適用分	40,776	26,613	3,262	2,129
19	うち、標準的手法準拠方式適用分	—	—	—	—
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	18	30	1	2
20	マーケット・リスク	1,152,699	1,006,275	92,215	80,502
21	うち、標準的方式適用分	1,152,699	1,006,275	92,215	80,502
22	うち、内部モデル方式適用分	—	—	—	—
	うち、簡易的方式適用分	—	—	—	—
23	勘定間の振替分	—	—	—	—
24	オペレーショナル・リスク	1,352,426	1,352,426	108,194	108,194
25	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	546,769	489,448	43,741	39,155
26	フロア調整	—	—	—	—
27	合計	24,273,789	23,731,010	1,941,903	1,898,480