

リスク・アセットの概要(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)

OV1:リスク・アセットの概要		イ	ロ	ハ	ニ
国際様式の 該当番号		リスク・アセット		所要自己資本	
		2024年9月末	2024年6月末	2024年9月末	2024年6月末
1	信用リスク	14,783,312	15,598,903	1,182,664	1,247,912
2	うち、標準的手法適用分	579,217	574,902	46,337	45,992
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	10,154,111	10,704,553	812,328	856,364
4	うち、スロッシング・クライテリア適用分	765,370	834,808	61,229	66,784
5	うち、先進的内部格付手法適用分	2,341,209	2,566,985	187,296	205,358
	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	355,193	326,735	28,415	26,138
	その他	588,209	590,918	47,056	47,273
6	カウンターパーティ信用リスク	408,372	546,258	32,669	43,700
7	うち、SA-CCR適用分	354,512	488,825	28,360	39,106
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	21,985	25,067	1,758	2,005
9	その他	31,874	32,365	2,549	2,589
10	CVAリスク	466,471	575,970	37,317	46,077
	うち、SA-CVA適用分	—	—	—	—
	うち、完全なBA-CVA適用分	466,471	575,970	37,317	46,077
	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	456,215	460,490	36,497	36,839
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(レック・スルー方式)	1,620,968	1,801,617	129,677	144,129
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)	1,570,452	1,676,162	125,636	134,092
	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%)	424	718	33	57
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	458,053	561,772	36,644	44,941
17	うち、内部格付手法準拠方式適用分	432,277	520,978	34,582	41,678
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	25,762	40,776	2,060	3,262
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	13	18	1	1
20	マーケット・リスク	1,032,409	1,152,699	82,592	92,215
21	うち、標準的方式適用分	1,032,409	1,152,699	82,592	92,215
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	1,511,525	1,352,426	120,922	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	559,144	546,769	44,731	43,741
26	フロア調整	—	—	—	—
27	合計	22,867,349	24,273,789	1,829,387	1,941,903