

リスク・アセットの概要(2025年3月期第3四半期)

【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					
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12月末	2024年9月末	2024年12月末	2024年9月末
1	信用リスク	15,031,757	14,783,312	1,202,540	1,182,664
2	うち、標準的手法適用分	584,726	579,217	46,778	46,337
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	10,292,368	10,154,111	823,389	812,328
4	うち、スロッシング・クライテリア適用分	805,398	765,370	64,431	61,229
5	うち、先進的内部格付手法適用分	2,428,847	2,341,209	194,307	187,296
	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	332,568	355,193	26,605	28,415
	その他	587,847	588,209	47,027	47,056
6	カウンターパーティ信用リスク	446,808	408,372	35,744	32,669
7	うち、SA-CCR適用分	392,869	354,512	31,429	28,360
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	23,602	21,985	1,888	1,758
9	その他	30,336	31,874	2,426	2,549
10	CVAリスク	475,197	466,471	38,015	37,317
	うち、SA-CVA適用分	—	—	—	—
	うち、完全なBA-CVA適用分	475,197	466,471	38,015	37,317
	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	514,531	456,215	41,162	36,497
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)	1,741,275	1,620,968	139,302	129,677
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)	1,703,684	1,570,452	136,294	125,636
	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%)	453	424	36	33
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	431,033	458,053	34,482	36,644
17	うち、内部格付手法準拠方式適用分	400,157	432,277	32,012	34,582
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	30,867	25,762	2,469	2,060
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	8	13	0	1
20	マーケット・リスク	1,015,982	1,032,409	81,278	82,592
21	うち、標準的方式適用分	1,015,982	1,032,409	81,278	82,592
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	1,511,525	120,922	120,922
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	566,123	559,144	45,289	44,731
26	フロア調整	—	—	—	—
27	合計	23,438,374	22,867,349	1,875,069	1,829,387