

リスク・アセットの概要 (2025年9月期)

【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	
		2025年9月末	2025年6月末	2025年9月末	2025年6月末
1	信用リスク	14,572,646	14,163,615	1,165,811	1,133,089
2	うち、標準的手法適用分	1,734,583	1,637,979	138,766	131,038
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	8,880,838	8,718,195	710,467	697,455
4	うち、スロットティング・クライテリア適用分	514,352	549,998	41,148	43,999
5	うち、先進的内部格付手法適用分	2,528,281	2,428,048	202,262	194,243
	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	245,881	219,012	19,670	17,521
	その他	668,708	610,379	53,496	48,830
6	カウンターパーティ信用リスク	424,555	360,027	33,964	28,802
7	うち、SA-CCR適用分	368,704	307,673	29,496	24,613
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	29,456	26,815	2,356	2,145
9	その他	26,394	25,539	2,111	2,043
10	CVAリスク	397,846	317,338	31,827	25,387
	うち、SA-CVA適用分	—	—	—	—
	うち、完全なBA-CVA適用分	397,846	317,338	31,827	25,387
	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	750,925	644,481	60,074	51,558
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)	1,781,871	1,698,933	142,549	135,914
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)	1,737,378	1,659,662	138,990	132,773
	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%)	332	320	26	25
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	414,864	453,815	33,189	36,305
17	うち、内部格付手法準拠方式適用分	391,905	428,662	31,352	34,293
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	22,953	25,146	1,836	2,011
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	5	6	0	0
20	マーケット・リスク	1,146,053	1,202,677	91,684	96,214
21	うち、標準的方式適用分	1,146,053	1,202,677	91,684	96,214
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	1,689,907	1,562,148	135,192	124,971
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	562,772	579,879	45,021	46,390
26	フロア調整	—	—	—	—
27	合計	23,479,154	22,642,898	1,878,332	1,811,431