

リスク・アセットの概要 (2025年12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12月末	2025年9月末	2025年12月末	2025年9月末
1	信用リスク	15,388,397	14,572,646	1,231,071	1,165,811
2	うち、標準的手法適用分	1,744,638	1,734,583	139,571	138,766
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	9,359,326	8,880,838	748,746	710,467
4	うち、スロットティング・クライテリア適用分	670,073	514,352	53,605	41,148
5	うち、先進的内部格付手法適用分	2,663,326	2,528,281	213,066	202,262
	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	317,145	245,881	25,371	19,670
	その他	633,888	668,708	50,711	53,496
6	カウンターパーティ信用リスク	505,983	424,555	40,478	33,964
7	うち、SA-CCR適用分	432,491	368,704	34,599	29,496
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	32,346	29,456	2,587	2,356
9	その他	41,145	26,394	3,291	2,111
10	CVAリスク	443,940	397,846	35,515	31,827
	うち、SA-CVA適用分	—	—	—	—
	うち、完全なBA-CVA適用分	443,940	397,846	35,515	31,827
	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	924,559	750,925	73,964	60,074
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)	1,876,670	1,781,871	150,133	142,549
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)	1,844,514	1,737,378	147,561	138,990
	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%)	305	332	24	26
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	531,019	414,864	42,481	33,189
17	うち、内部格付手法準拠方式適用分	503,083	391,905	40,246	31,352
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	27,930	22,953	2,234	1,836
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	4	5	0	0
20	マーケット・リスク	1,075,870	1,146,053	86,069	91,684
21	うち、標準的方式適用分	1,075,870	1,146,053	86,069	91,684
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	1,689,907	135,192	135,192
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	661,006	562,772	52,880	45,021
26	フロア調整	—	—	—	—
27	合計	24,942,176	23,479,154	1,995,374	1,878,332