

リスク・アセットの概要 (2024年3月期第2四半期)
 【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	
		2023年9月末	2023年6月末	2023年9月末	2023年6月末
1	信用リスク	14,318,394	13,969,064	1,206,651	1,177,192
2	うち、標準的手法適用分	543,641	524,345	43,491	41,947
3	うち、内部格付手法適用分	12,745,751	12,430,785	1,080,839	1,054,130
	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	279,946	282,065	22,395	22,565
	その他	749,053	731,867	59,924	58,549
4	カウンターパーティ信用リスク	1,394,118	1,332,840	113,853	108,802
5	うち、SA-CCR適用分	-	-	-	-
	うち、カレント・エクスポージャー方式適用分	468,784	438,506	39,729	37,163
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	691,216	681,344	55,297	54,507
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	70,897	62,007	5,671	4,960
	その他	163,220	150,982	13,155	12,171
7	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	326,544	366,520	27,690	31,080
8	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)	1,844,434	2,013,724	147,554	161,097
9	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)	1,854,952	1,783,210	148,396	142,656
	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%)	-	-	-	-
10	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1,250%)	841	1,247	67	99
11	未決済取引	-	-	-	-
12	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	371,322	345,492	29,705	27,639
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	355,787	329,183	28,463	26,334
14	うち、外部格付準拠方式適用分	15,451	16,188	1,236	1,295
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	-	-	-	-
	うち、1,250%のリスク・ウェイト適用分	83	119	6	9
16	マーケット・リスク	1,819,474	1,607,871	145,557	128,629
17	うち、標準的方式適用分	116,391	93,252	9,311	7,460
18	うち、内部モデル方式適用分	1,703,082	1,514,618	136,246	121,169
19	オペレーショナル・リスク	1,076,844	1,006,720	86,147	80,537
20	うち、基礎的手法適用分	242,863	219,688	19,429	17,575
21	うち、粗利益配分手法適用分	-	-	-	-
22	うち、先進的計測手法適用分	833,980	787,031	66,718	62,962
23	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	460,936	509,080	39,087	43,170
	経過措置によりリスク・アセットの額に算入されるものの額	-	-	-	-
24	フロア調整	-	-	-	-
25	合計 (スケールリングファクター適用後)*	24,308,911	23,761,343	1,944,712	1,900,907

* 項番25のリスク・アセットのみスケールリングファクターを適用した値を記載しております。