

リスク・アセットの概要(2024年3月期)
 【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		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3月末	2023年12月末	2024年3月末	2023年12月末
1	信用リスク	15,861,133		1,268,890	
2	うち、標準的手法適用分	555,733		44,458	
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	10,858,672		868,693	
4	うち、スロッシング・クライテリア適用分	799,142		63,931	
5	うち、先進的内部格付手法適用分	2,512,404		200,992	
	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	295,966		23,677	
	その他	839,212		67,136	
6	カウンターパーティ信用リスク	458,567		36,685	
7	うち、SA-CCR適用分	419,098		33,527	
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	7,986		638	
9	その他	31,482		2,518	
10	CVAリスク	512,641		41,011	
	うち、SA-CVA適用分	—		—	
	うち、完全なBA-CVA適用分	512,641		41,011	
	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	426,085		34,086	
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)	1,634,100		130,728	
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)	1,551,123		124,089	
	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%)	746		59	
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	438,462		35,076	
17	うち、内部格付手法準拠方式適用分	411,818		32,945	
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	26,613		2,129	
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	30		2	
20	マーケット・リスク	1,006,275		80,502	
21	うち、標準的方式適用分	1,006,275		80,502	
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	1,352,426		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	489,448		39,155	
26	フロア調整	—		—	
27	合計	23,731,010		1,898,480	

(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3月末	2023年12月末	2024年3月末	2023年12月末
1	信用リスク		14,436,025		1,216,459
2	うち、標準的手法適用分		580,795		46,463
3	うち、内部格付手法適用分		12,828,700		1,087,873
	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		279,884		22,390
	その他		746,645		59,731
4	カウンターパーティ信用リスク		1,202,057		98,029
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		379,652		32,177
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分		-		-
	うち、CVAリスク		605,750		48,460
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー		71,014		5,681
	その他		145,639		11,710
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		336,462		28,531
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(リスク・スルー方式)		1,669,834		133,586
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)		1,886,607		150,928
	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%)		800		64
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		404,439		32,355
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分		383,178		30,654
14	うち、外部格付準拠方式適用分		21,214		1,697
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		46		3
16	マーケット・リスク		1,760,067		140,805
17	うち、標準的方式適用分		111,706		8,936
18	うち、内部モデル方式適用分		1,648,361		131,868
19	オペレーショナル・リスク		1,076,844		86,147
20	うち、基礎的手法適用分		242,863		19,429
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		66,718
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		475,097		40,288
	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)*		24,089,963		1,927,197

* 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。