

内部格付手法を適用した信用リスク・エクスポージャーのリスク・アセット変動表(2024年3月期第4四半期)

【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: 百億円)

| CR8:内部格付手法を適用した信用リスク・エクスポージャーのリスク・アセット変動表 |                         |              |      |
|---|-------------------------|--------------|------|
| 項番  |                         | 信用リスク・アセットの額 |      |
| 1   | 前四半期末時点における信用リスク・アセットの額 | 1,415        |      |
| 2   | 当四半期中の<br>要因別の<br>変動額   | 資産の規模        | 38   |
| 3   |                         | ポートフォリオの質    | △ 28 |
| 4   |                         | モデルの更新       | —    |
| 5   |                         | 手法及び方針       | 111  |
| 6   |                         | 買収又は売却       | —    |
| 7   |                         | 為替の変動        | 23   |
| 8   |                         | その他          | —    |
| 9   | 当四半期末時点における信用リスク・アセットの額 | 1,560        |      |

(注)

前四半期末:2023年12月末、当四半期末:2024年3月末