

リスク・アセットの概要(2021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	
		2020年9月末	2020年6月末	2020年9月末	2020年6月末
1	信用リスク	12,190,163	12,388,708	1,029,198	1,046,013
2	うち、標準的手法適用分	360,181	356,645	28,814	28,531
3	うち、内部格付手法適用分	11,246,861	11,440,994	953,733	970,196
	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	62,402	48,810	4,992	3,904
	その他	520,718	542,258	41,657	43,380
4	カウンターパーティ信用リスク	1,214,138	1,176,423	99,114	96,033
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	389,657	379,676	33,031	32,183
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	666,795	650,698	53,343	52,055
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	52,555	57,611	4,204	4,608
	その他	105,129	88,437	8,534	7,185
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	251,342	360,845	21,313	30,599
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)	1,347,200	994,981	107,776	79,598
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)	946,431	898,992	75,714	71,919
	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%)	1,103	1,135	88	90
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	313,985	322,503	25,118	25,800
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	295,189	309,035	23,615	24,722
14	うち、外部格付準拠方式適用分	18,056	12,646	1,444	1,011
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	739	821	59	65
16	マーケット・リスク	1,330,714	1,297,712	106,457	103,817
17	うち、標準的方式適用分	21,243	21,997	1,699	1,759
18	うち、内部モデル方式適用分	1,309,470	1,275,714	104,757	102,057
19	オペレーショナル・リスク	987,251	941,219	78,980	75,297
20	うち、基礎的手法適用分	186,722	186,498	14,937	14,919
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	800,529	754,721	64,042	60,377
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	390,646	385,893	33,126	32,723
	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)*	19,711,096	19,523,675	1,576,887	1,561,894

* 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。