

リスク・アセットの概要(2021年3月期第3四半期)
【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12月末	2020年9月末	2020年12月末	2020年9月末
1	信用リスク	12,297,225	12,190,163	1,038,634	1,029,198
2	うち、標準的手法適用分	313,246	360,181	25,059	28,814
3	うち、内部格付手法適用分	11,428,482	11,246,861	969,135	953,733
	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	74,935	62,402	5,994	4,992
	その他	480,561	520,718	38,444	41,657
4	カウンターパーティ信用リスク	1,255,599	1,214,138	102,533	99,114
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	408,933	389,657	34,664	33,031
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	699,476	666,795	55,958	53,343
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	42,452	52,555	3,396	4,204
	その他	104,737	105,129	8,514	8,534
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	310,873	251,342	26,362	21,313
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)	1,306,904	1,347,200	104,552	107,776
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)	1,004,912	946,431	80,393	75,714
	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%)	1,020	1,103	81	88
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	288,373	313,985	23,069	25,118
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	265,924	295,189	21,273	23,615
14	うち、外部格付準拠方式適用分	21,787	18,056	1,743	1,444
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	661	739	52	59
16	マーケット・リスク	1,601,633	1,330,714	128,130	106,457
17	うち、標準的方式適用分	21,121	21,243	1,689	1,699
18	うち、内部モデル方式適用分	1,580,512	1,309,470	126,440	104,757
19	オペレーショナル・リスク	987,251	987,251	78,980	78,980
20	うち、基礎的手法適用分	186,722	186,722	14,937	14,937
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	800,529	64,042	64,042
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	401,418	390,646	34,040	33,126
	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)*	20,209,728	19,711,096	1,616,778	1,576,887

* 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。