

リスク・アセットの概要(2021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					
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	
		2021年3月末	2020年12月末	2021年3月末	2020年12月末
1	信用リスク	12,476,989	12,297,225	1,053,378	1,038,634
2	うち、標準的手法適用分	370,123	313,246	29,609	25,059
3	うち、内部格付手法適用分	11,503,965	11,428,482	975,536	969,135
	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	76,111	74,935	6,088	5,994
	その他	526,789	480,561	42,143	38,444
4	カウンターパーティ信用リスク	1,245,732	1,255,599	101,741	102,533
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	407,852	408,933	34,573	34,664
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	675,826	699,476	54,066	55,958
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	47,434	42,452	3,794	3,396
	その他	114,618	104,737	9,307	8,514
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	499,442	310,873	42,352	26,362
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)	1,054,073	1,306,904	84,325	104,552
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)	1,072,252	1,004,912	85,780	80,393
	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%)	1,091	1,020	87	81
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	309,080	288,373	24,726	23,069
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	291,351	265,924	23,308	21,273
14	うち、外部格付準拠方式適用分	17,132	21,787	1,370	1,743
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	597	661	47	52
16	マーケット・リスク	1,427,275	1,601,633	114,182	128,130
17	うち、標準的方式適用分	22,017	21,121	1,761	1,689
18	うち、内部モデル方式適用分	1,405,258	1,580,512	112,420	126,440
19	オペレーショナル・リスク	972,392	987,251	77,791	78,980
20	うち、基礎的手法適用分	191,747	186,722	15,339	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	780,645	800,529	62,451	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	413,988	401,418	35,106	34,040
	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)*	20,243,399	20,209,728	1,619,471	1,616,778

\* 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。