

リスク・アセットの概要(2022年3月期第1四半期)
【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	
		2021年6月末	2021年3月末	2021年6月末	2021年3月末
1	信用リスク	12,220,911	12,476,989	1,031,663	1,053,378
2	うち、標準的手法適用分	338,807	370,123	27,104	29,609
3	うち、内部格付手法適用分	11,247,965	11,503,965	953,827	975,536
	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	88,088	76,111	7,047	6,088
	その他	546,050	526,789	43,684	42,143
4	カウンターパーティ信用リスク	1,201,725	1,245,732	98,156	101,741
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	394,547	407,852	33,444	34,573
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	632,426	675,826	50,594	54,066
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	47,618	47,434	3,809	3,794
	その他	127,132	114,618	10,308	9,307
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	343,327	499,442	29,114	42,352
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)	992,726	1,054,073	79,418	84,325
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)	1,119,640	1,072,252	89,571	85,780
	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%)	1,067	1,091	85	87
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	271,680	309,080	21,734	24,726
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	255,717	291,351	20,457	23,308
14	うち、外部格付準拠方式適用分	15,439	17,132	1,235	1,370
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	523	597	41	47
16	マーケット・リスク	1,719,211	1,427,275	137,536	114,182
17	うち、標準的方式適用分	22,859	22,017	1,828	1,761
18	うち、内部モデル方式適用分	1,696,352	1,405,258	135,708	112,420
19	オペレーショナル・リスク	972,392	972,392	77,791	77,791
20	うち、基礎的手法適用分	191,747	191,747	15,339	15,339
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	780,645	62,451	62,451
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	425,607	413,988	36,091	35,106
	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 (スケーリングファクター適用後)*	20,014,533	20,243,399	1,601,162	1,619,471

* 項番25のリスク・アセットのみスケーリングファクターを適用した値を記載しております。