

リスク・アセットの概要(2022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	
		2021年9月末	2021年6月末	2021年9月末	2021年6月末
1	信用リスク	12,108,180	12,220,911	1,022,293	1,031,663
2	うち、標準的手法適用分	316,819	338,807	25,345	27,104
3	うち、内部格付手法適用分	11,174,758	11,247,965	947,619	953,827
	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	81,493	88,088	6,519	7,047
	その他	535,108	546,050	42,808	43,684
4	カウンターパーティ信用リスク	1,225,138	1,201,725	100,026	98,156
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	396,866	394,547	33,643	33,444
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	654,699	632,426	52,375	50,594
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	48,017	47,618	3,841	3,809
	その他	125,554	127,132	10,165	10,308
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	271,132	343,327	22,992	29,114
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)	831,712	992,726	66,536	79,418
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)	1,176,542	1,119,640	94,123	89,571
	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%)	1,118	1,067	89	85
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	258,849	271,680	20,707	21,734
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	245,083	255,717	19,606	20,457
14	うち、外部格付準拠方式適用分	13,307	15,439	1,064	1,235
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	458	523	36	41
16	マーケット・リスク	1,656,274	1,719,211	132,501	137,536
17	うち、標準的方式適用分	37,765	22,859	3,021	1,828
18	うち、内部モデル方式適用分	1,618,508	1,696,352	129,480	135,708
19	オペレーショナル・リスク	948,973	972,392	75,917	77,791
20	うち、基礎的手法適用分	201,912	191,747	16,152	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	747,061	780,645	59,764	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	457,561	425,607	38,801	36,091
	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)*	19,674,886	20,014,533	1,573,990	1,601,162

* 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。