

リスク・アセットの概要(2022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	
		2021年12月末	2021年9月末	2021年12月末	2021年9月末
1	信用リスク	12,148,885	12,108,180	1,025,430	1,022,293
2	うち、標準的手法適用分	377,278	316,819	30,182	25,345
3	うち、内部格付手法適用分	11,149,967	11,174,758	945,517	947,619
	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	81,590	81,493	6,527	6,519
	その他	540,049	535,108	43,203	42,808
4	カウンターパーティ信用リスク	1,202,600	1,225,138	98,202	100,026
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	396,058	396,866	33,567	33,643
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	640,161	654,699	51,212	52,375
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	48,274	48,017	3,861	3,841
	その他	118,106	125,554	9,560	10,165
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	270,253	271,132	22,917	22,992
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)	815,010	831,712	65,200	66,536
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)	1,228,062	1,176,542	98,245	94,123
	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%)	1,087	1,118	86	89
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	287,204	258,849	22,976	20,707
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	267,813	245,083	21,425	19,606
14	うち、外部格付準拠方式適用分	18,984	13,307	1,518	1,064
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	406	458	32	36
16	マーケット・リスク	1,848,547	1,656,274	147,883	132,501
17	うち、標準的方式適用分	29,597	37,765	2,367	3,021
18	うち、内部モデル方式適用分	1,818,949	1,618,508	145,515	129,480
19	オペレーショナル・リスク	948,973	948,973	75,917	75,917
20	うち、基礎的手法適用分	201,912	201,912	16,152	16,152
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	747,061	59,764	59,764
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	470,774	457,561	39,921	38,801
	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)*	19,959,789	19,674,886	1,596,783	1,573,990

\* 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。