

リスク・アセットの概要(2022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	
		2022年3月末	2021年12月末	2022年3月末	2021年12月末
1	信用リスク	12,428,600	12,148,885	1,048,742	1,025,430
2	うち、標準的手法適用分	410,820	377,278	32,865	30,182
3	うち、内部格付手法適用分	11,344,677	11,149,967	962,028	945,517
	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	66,079	81,590	5,286	6,527
	その他	607,023	540,049	48,561	43,203
4	カウンターパーティ信用リスク	1,271,839	1,202,600	103,834	98,202
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	409,215	396,058	34,692	33,567
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	660,133	640,161	52,810	51,212
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	55,007	48,274	4,400	3,861
	その他	147,482	118,106	11,930	9,560
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	226,481	270,253	19,205	22,917
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)	893,876	815,010	71,510	65,200
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)	1,363,728	1,228,062	109,098	98,245
	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%)	1,448	1,087	115	86
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	357,010	287,204	28,560	22,976
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	341,805	267,813	27,344	21,425
14	うち、外部格付準拠方式適用分	14,852	18,984	1,188	1,518
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	352	406	28	32
16	マーケット・リスク	1,268,574	1,848,547	101,485	147,883
17	うち、標準的方式適用分	33,718	29,597	2,697	2,367
18	うち、内部モデル方式適用分	1,234,856	1,818,949	98,788	145,515
19	オペレーショナル・リスク	945,703	948,973	75,656	75,917
20	うち、基礎的手法適用分	209,208	201,912	16,736	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	736,495	747,061	58,919	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	620,460	470,774	52,615	39,921
	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)*	20,135,316	19,959,789	1,610,825	1,596,783

\* 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。