

リスク・アセットの概要(2023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	
		2022年6月末	2022年3月末	2022年6月末	2022年3月末
1	信用リスク	12,597,436	12,428,600	1,062,233	1,048,742
2	うち、標準的手法適用分	463,438	410,820	37,075	32,865
3	うち、内部格付手法適用分	11,341,344	11,344,677	961,746	962,028
	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	85,208	66,079	6,816	5,286
	その他	707,443	607,023	56,595	48,561
4	カウンターパーティ信用リスク	1,294,179	1,271,839	105,657	103,834
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	419,369	409,215	35,546	34,692
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	651,887	660,133	52,151	52,810
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	67,871	55,007	5,429	4,400
	その他	155,050	147,482	12,529	11,930
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	420,442	226,481	35,653	19,205
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)	759,179	893,876	60,734	71,510
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)	1,525,517	1,363,728	122,041	109,098
	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%)	1,683	1,448	134	115
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	377,244	357,010	30,179	28,560
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	360,419	341,805	28,833	27,344
14	うち、外部格付準拠方式適用分	16,529	14,852	1,322	1,188
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	295	352	23	28
16	マーケット・リスク	1,386,206	1,268,574	110,896	101,485
17	うち、標準的方式適用分	37,730	33,718	3,018	2,697
18	うち、内部モデル方式適用分	1,348,475	1,234,856	107,878	98,788
19	オペレーショナル・リスク	945,703	945,703	75,656	75,656
20	うち、基礎的手法適用分	209,208	209,208	16,736	16,736
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	736,495	58,919	58,919
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	653,654	620,460	55,429	52,615
	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)*	20,732,714	20,135,316	1,658,617	1,610,825

* 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。