

リスク・アセットの概要(2023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	
		2022年9月末	2022年6月末	2022年9月末	2022年6月末
1	信用リスク	13,037,315	12,597,436	1,099,353	1,062,233
2	うち、標準的手法適用分	481,523	463,438	38,521	37,075
3	うち、内部格付手法適用分	11,743,370	11,341,344	995,837	961,746
	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	90,940	85,208	7,275	6,816
	その他	721,481	707,443	57,718	56,595
4	カウンターパーティ信用リスク	1,293,371	1,294,179	105,554	105,657
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	421,937	419,369	35,756	35,546
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	644,577	651,887	51,566	52,151
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	79,751	67,871	6,380	5,429
	その他	147,104	155,050	11,851	12,529
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	384,854	420,442	32,635	35,653
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)	1,273,152	759,179	101,852	60,734
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)	2,151,178	1,525,517	172,094	122,041
	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%)	1,762	1,683	140	134
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	416,099	377,244	33,287	30,179
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	399,947	360,419	31,995	28,833
14	うち、外部格付準拠方式適用分	15,904	16,529	1,272	1,322
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	247	295	19	23
16	マーケット・リスク	1,306,218	1,386,206	104,497	110,896
17	うち、標準的方式適用分	49,658	37,730	3,972	3,018
18	うち、内部モデル方式適用分	1,256,559	1,348,475	100,524	107,878
19	オペレーショナル・リスク	957,726	945,703	76,618	75,656
20	うち、基礎的手法適用分	211,754	209,208	16,940	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	745,971	736,495	59,677	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	676,956	653,654	57,405	55,429
	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)*	22,293,002	20,732,714	1,783,440	1,658,617

\* 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。