

リスク・アセットの概要(2023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<br>該当番号   |   | イ          | ロ          | ハ         | ニ         |
|                 |   | リスク・アセット   |            | 所要自己資本    |           |
|                 |   | 2022年12月末  | 2022年9月末   | 2022年12月末 | 2022年9月末  |
| 1               | 信用リスク   | 12,998,222 | 13,037,315 | 1,096,489 | 1,099,353 |
| 2               | うち、標準的手法適用分                                       | 465,864    | 481,523    | 37,269    | 38,521    |
| 3               | うち、内部格付手法適用分                                      | 11,798,335 | 11,743,370 | 1,000,498 | 995,837   |
|                 | 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                       | 104,022    | 90,940     | 8,321     | 7,275     |
|                 | その他   | 630,000    | 721,481    | 50,400    | 57,718    |
| 4               | カウンターパーティ信用リスク                                    | 1,108,132  | 1,293,371  | 90,371    | 105,554   |
| 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                             | 346,217    | 421,937    | 29,344    | 35,756    |
| 6               | うち、期待エクスポージャー方式適用分                                | -          | -          | -         | -         |
|                 | うち、CVAリスク   | 551,688    | 644,577    | 44,135    | 51,566    |
|                 | うち、中央清算機関関連エクスポージャー                               | 72,996     | 79,751     | 5,839     | 6,380     |
|                 | その他   | 137,231    | 147,104    | 11,052    | 11,851    |
| 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                        | 228,901    | 384,854    | 19,410    | 32,635    |
| 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)       | 2,117,318  | 1,273,152  | 169,385   | 101,852   |
| 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)         | 1,482,276  | 2,151,178  | 118,582   | 172,094   |
|                 | 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%) | 1,303      | 1,762      | 104       | 140       |
| 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                | 338,631    | 416,099    | 27,090    | 33,287    |
| 13              | うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分                          | 319,682    | 399,947    | 25,574    | 31,995    |
| 14              | うち、外部格付準拠方式適用分                                    | 18,744     | 15,904     | 1,499     | 1,272     |
| 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                             | 205        | 247        | 16        | 19        |
| 16              | マーケット・リスク   | 1,993,183  | 1,306,218  | 159,454   | 104,497   |
| 17              | うち、標準的方式適用分                                       | 77,866     | 49,658     | 6,229     | 3,972     |
| 18              | うち、内部モデル方式適用分                                     | 1,915,316  | 1,256,559  | 153,225   | 100,524   |
| 19              | オペレーショナル・リスク                                      | 957,726    | 957,726    | 76,618    | 76,618    |
| 20              | うち、基礎的手法適用分                                       | 211,754    | 211,754    | 16,940    | 16,940    |
| 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    | 745,971    | 59,677    | 59,677    |
| 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                  | 675,067    | 676,956    | 57,245    | 57,405    |
|                 | 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)*                              | 22,684,414 | 22,293,002 | 1,814,753 | 1,783,440 |

\* 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。