

リスク・アセットの概要(2023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 | |
| | | 2023年3月末 | 2022年12月末 | 2023年3月末 | 2022年12月末 |
| 1 | 信用リスク | 13,526,356 | 12,998,222 | 1,140,774 | 1,096,489 |
| 2 | うち、標準的手法適用分 | 556,708 | 465,864 | 44,536 | 37,269 |
| 3 | うち、内部格付手法適用分 | 12,222,112 | 11,798,335 | 1,036,435 | 1,000,498 |
| | 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 | 138,902 | 104,022 | 11,112 | 8,321 |
| | その他 | 608,633 | 630,000 | 48,690 | 50,400 |
| 4 | カウンターパーティ信用リスク | 1,234,786 | 1,108,132 | 100,644 | 90,371 |
| 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 | 375,435 | 346,217 | 31,818 | 29,344 |
| 6 | うち、期待エクスポージャー方式適用分 | - | - | - | - |
| | うち、CVAリスク | 644,470 | 551,688 | 51,557 | 44,135 |
| | うち、中央清算機関関連エクスポージャー | 76,398 | 72,996 | 6,111 | 5,839 |
| | その他 | 138,481 | 137,231 | 11,156 | 11,052 |
| 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 | 301,987 | 228,901 | 25,608 | 19,410 |
| 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) | 1,987,217 | 2,117,318 | 158,977 | 169,385 |
| 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) | 1,669,856 | 1,482,276 | 133,588 | 118,582 |
| | 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%) | 1,311 | 1,303 | 104 | 104 |
| 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 | 320,847 | 338,631 | 25,667 | 27,090 |
| 13 | うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分 | 303,454 | 319,682 | 24,276 | 25,574 |
| 14 | うち、外部格付準拠方式適用分 | 17,232 | 18,744 | 1,378 | 1,499 |
| 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 | 160 | 205 | 12 | 16 |
| 16 | マーケット・リスク | 1,838,234 | 1,993,183 | 147,058 | 159,454 |
| 17 | うち、標準的方式適用分 | 82,169 | 77,866 | 6,573 | 6,229 |
| 18 | うち、内部モデル方式適用分 | 1,756,065 | 1,915,316 | 140,485 | 153,225 |
| 19 | オペレーショナル・リスク | 1,006,720 | 957,726 | 80,537 | 76,618 |
| 20 | うち、基礎的手法適用分 | 219,688 | 211,754 | 17,575 | 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 | 787,031 | 745,971 | 62,962 | 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 | 561,184 | 675,067 | 47,588 | 57,245 |
| | 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)* | 23,256,895 | 22,684,414 | 1,860,551 | 1,814,753 |

* 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。