

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。