

リスク・アセットの概要(2018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	
		2018年3月末	2017年12月末	2018年3月末	2017年12月末
1	信用リスク	13,561,470		1,145,814	
2	うち、標準的手法適用分	396,999		31,759	
3	うち、内部格付手法適用分	12,686,915		1,075,850	
	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	1,408		112	
	その他	476,147		38,091	
4	カウンターパーティ信用リスク	731,333		59,685	
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	230,244		19,516	
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-		-	
	うち、CVAリスク	389,775		31,182	
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	32,381		2,590	
	その他	78,932		6,396	
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	301,603		25,575	
	複数の資産及び取引を裏付けとするエクスポージャー	-		-	
	信用リスク・アセットのみなし計算が適用されるエクスポージャー	2,417,704		205,021	
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	159,362		13,513	
13	うち、内部格付手法における外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分	37,134		3,148	
14	うち、内部格付手法における指定関数方式適用分	71,623		6,073	
15	うち、標準的手法適用分	-		-	
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	50,604		4,291	
16	マーケット・リスク	1,163,880		93,110	
17	うち、標準的方式適用分	170,246		13,619	
18	うち、内部モデル方式適用分	993,634		79,490	
19	オペレーショナル・リスク	1,006,898		80,551	
20	うち、基礎的手法適用分	164,375		13,150	
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	842,523		67,401	
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	218,903		18,563	
	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)*	20,522,957		1,641,836	

* 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。