

リスク・アセットの概要(2019年3月期第1四半期)
【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 | |
| | | 2018年6月末 | 2018年3月末 | 2018年6月末 | 2018年3月末 |
| 1 | 信用リスク | 13,324,413 | 13,561,470 | 1,125,154 | 1,145,814 |
| 2 | うち、標準的手法適用分 | 457,026 | 396,999 | 36,562 | 31,759 |
| 3 | うち、内部格付手法適用分 | 12,333,617 | 12,686,915 | 1,045,890 | 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 | 1,427 | 1,408 | 114 | 112 |
| | その他 | 532,342 | 476,147 | 42,587 | 38,091 |
| 4 | カウンターパーティ信用リスク | 683,934 | 731,333 | 55,816 | 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 | 214,642 | 230,244 | 18,187 | 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 | 354,509 | 389,775 | 28,360 | 31,182 |
| | うち、中央清算機関関連エクスポージャー | 37,603 | 32,381 | 3,008 | 2,590 |
| | その他 | 77,178 | 78,932 | 6,259 | 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 | 386,548 | 301,603 | 32,779 | 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 | 2,342,709 | 2,417,704 | 198,661 | 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 | 152,197 | 159,362 | 12,906 | 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 | 41,711 | 37,134 | 3,537 | 3,148 |
| 14 | うち、内部格付手法における指定関数方式適用分 | 60,680 | 71,623 | 5,145 | 6,073 |
| 15 | うち、標準的手法適用分 | - | - | - | - |
| | うち、1,250%のリスク・ウェイト適用分 | 49,805 | 50,604 | 4,223 | 4,291 |
| 16 | マーケット・リスク | 1,241,486 | 1,163,880 | 99,318 | 93,110 |
| 17 | うち、標準的方式適用分 | 166,600 | 170,246 | 13,328 | 13,619 |
| 18 | うち、内部モデル方式適用分 | 1,074,886 | 993,634 | 85,990 | 79,490 |
| 19 | オペレーショナル・リスク | 1,006,898 | 1,006,898 | 80,551 | 80,551 |
| 20 | うち、基礎的手法適用分 | 164,375 | 164,375 | 13,150 | 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 | 842,523 | 67,401 | 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 | 243,320 | 218,903 | 20,633 | 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 (スケーリングファクター適用後)* | 20,322,781 | 20,522,957 | 1,625,822 | 1,641,836 |

* 項番25のリスク・アセットのみスケーリングファクターを適用した値を記載しております。