

リスク・アセットの概要(2020年3月期第2四半期)  
 [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	
		2019年9月末	2019年6月末	2019年9月末	2019年6月末
1	信用リスク	12,227,004	12,725,134	1,032,852	1,074,775
2	うち、標準的手法適用分	311,572	337,289	24,925	26,983
3	うち、内部格付手法適用分	11,394,191	11,825,949	966,227	1,002,840
	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	30,359	29,832	2,428	2,386
	その他	490,881	532,063	39,270	42,565
4	カウンターパーティ信用リスク	1,085,194	999,707	88,507	81,553
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	335,089	312,754	28,400	26,505
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	613,982	554,925	49,118	44,394
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	47,669	48,931	3,813	3,914
	その他	88,452	83,095	7,175	6,739
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	240,052	236,769	20,356	20,078
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)	1,235,895	1,111,600	98,871	88,928
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)	824,931	742,659	65,994	59,412
	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%)	1,238	1,250	99	100
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	345,127	342,513	27,610	27,401
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	331,655	327,073	26,532	26,165
14	うち、外部格付準拠方式適用分	12,391	14,254	991	1,140
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	1,080	1,186	86	94
16	マーケット・リスク	989,769	1,075,899	79,181	86,071
17	うち、標準的方式適用分	19,884	20,721	1,590	1,657
18	うち、内部モデル方式適用分	969,885	1,055,177	77,590	84,414
19	オペレーショナル・リスク	949,961	960,854	75,996	76,868
20	うち、基礎的手法適用分	180,097	174,122	14,407	13,929
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	769,863	786,731	61,589	62,938
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	369,644	374,102	31,345	31,723
	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)*	19,010,206	19,336,412	1,520,816	1,546,913

\* 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。