

リスク・アセットの概要(2020年3月期第3四半期)  
 【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12月末	2019年9月末	2019年12月末	2019年9月末
1	信用リスク	12,400,404	12,227,004	1,047,214	1,032,852
2	うち、標準的手法適用分	348,792	311,572	27,903	24,925
3	うち、内部格付手法適用分	11,496,311	11,394,191	974,887	966,227
	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	24,887	30,359	1,990	2,428
	その他	530,413	490,881	42,433	39,270
4	カウンターパーティ信用リスク	1,075,571	1,085,194	87,714	88,507
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	327,626	335,089	27,768	28,400
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	611,435	613,982	48,914	49,118
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	41,936	47,669	3,354	3,813
	その他	94,572	88,452	7,676	7,175
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	229,371	240,052	19,450	20,356
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)	1,465,882	1,235,895	117,270	98,871
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)	884,336	824,931	70,746	65,994
	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%)	1,146	1,238	91	99
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	340,905	345,127	27,272	27,610
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	327,646	331,655	26,211	26,532
14	うち、外部格付準拠方式適用分	12,269	12,391	981	991
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	989	1,080	79	86
16	マーケット・リスク	1,305,445	989,769	104,435	79,181
17	うち、標準的方式適用分	20,223	19,884	1,617	1,590
18	うち、内部モデル方式適用分	1,285,221	969,885	102,817	77,590
19	オペレーショナル・リスク	949,961	949,961	75,996	75,996
20	うち、基礎的手法適用分	180,097	180,097	14,407	14,407
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	769,863	61,589	61,589
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	370,630	369,644	31,429	31,345
	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)	19,770,298	19,010,206	1,581,623	1,520,816

\* 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。