

リスク・アセットの概要(2020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	
		2020年3月末	2019年12月末	2020年3月末	2019年12月末
1	信用リスク	12,172,577	12,400,404	1,028,035	1,047,214
2	うち、標準的手法適用分	291,431	348,792	23,314	27,903
3	うち、内部格付手法適用分	11,297,792	11,496,311	958,052	974,887
	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	59,850	24,887	4,788	1,990
	その他	523,503	530,413	41,880	42,433
4	カウンターパーティ信用リスク	1,202,212	1,075,571	98,141	87,714
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	393,082	327,626	33,317	27,768
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	663,147	611,435	53,051	48,914
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	49,867	41,936	3,989	3,354
	その他	96,113	94,572	7,782	7,676
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	221,843	229,371	18,812	19,450
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)	861,656	1,465,882	68,932	117,270
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)	849,782	884,336	67,982	70,746
	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%)	1,137	1,146	91	91
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	348,026	340,905	27,842	27,272
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	334,315	327,646	26,745	26,211
14	うち、外部格付準拠方式適用分	12,804	12,269	1,024	981
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	906	989	72	79
16	マーケット・リスク	1,334,541	1,305,445	106,763	104,435
17	うち、標準的方式適用分	22,727	20,223	1,818	1,617
18	うち、内部モデル方式適用分	1,311,813	1,285,221	104,945	102,817
19	オペレーショナル・リスク	941,219	949,961	75,297	75,996
20	うち、基礎的手法適用分	186,498	180,097	14,919	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	754,721	769,863	60,377	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	382,294	370,630	32,418	31,429
	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)*	19,053,967	19,770,298	1,524,317	1,581,623

\* 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。