

リスク・アセットの概要(2021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	
		2020年6月末	2020年3月末	2020年6月末	2020年3月末
1	信用リスク	12,388,708	12,172,577	1,046,013	1,028,035
2	うち、標準的手法適用分	356,645	291,431	28,531	23,314
3	うち、内部格付手法適用分	11,440,994	11,297,792	970,196	958,052
	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	48,810	59,850	3,904	4,788
	その他	542,258	523,503	43,380	41,880
4	カウンターパーティ信用リスク	1,176,423	1,202,212	96,033	98,141
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	379,676	393,082	32,183	33,317
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	650,698	663,147	52,055	53,051
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	57,611	49,867	4,608	3,989
	その他	88,437	96,113	7,185	7,782
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	360,845	221,843	30,599	18,812
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)	994,981	861,656	79,598	68,932
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)	898,992	849,782	71,919	67,982
	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%)	1,135	1,137	90	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	322,503	348,026	25,800	27,842
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	309,035	334,315	24,722	26,745
14	うち、外部格付準拠方式適用分	12,646	12,804	1,011	1,024
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	821	906	65	72
16	マーケット・リスク	1,297,712	1,334,541	103,817	106,763
17	うち、標準的方式適用分	21,997	22,727	1,759	1,818
18	うち、内部モデル方式適用分	1,275,714	1,311,813	102,057	104,945
19	オペレーショナル・リスク	941,219	941,219	75,297	75,297
20	うち、基礎的手法適用分	186,498	186,498	14,919	14,919
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	754,721	60,377	60,377
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	385,893	382,294	32,723	32,418
	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)*	19,523,675	19,053,967	1,561,894	1,524,317

\* 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。