

リスク・アセットの概要(2018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 | |
| | | 2018年3月末 | 2017年12月末 | 2018年3月末 | 2017年12月末 |
| 1 | 信用リスク | 13,561,470 | | 1,145,814 | |
| 2 | うち、標準的手法適用分 | 396,999 | | 31,759 | |
| 3 | うち、内部格付手法適用分 | 12,686,915 | | 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 | 1,408 | | 112 | |
| | その他 | 476,147 | | 38,091 | |
| 4 | カウンターパーティ信用リスク | 731,333 | | 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 | 230,244 | | 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 | 389,775 | | 31,182 | |
| | うち、中央清算機関関連エクスポージャー | 32,381 | | 2,590 | |
| | その他 | 78,932 | | 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 | 301,603 | | 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 | 2,417,704 | | 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 | 159,362 | | 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 | 37,134 | | 3,148 | |
| 14 | うち、内部格付手法における指定関数方式適用分 | 71,623 | | 6,073 | |
| 15 | うち、標準的手法適用分 | - | | - | |
| | うち、1250%のリスク・ウェイト適用分 | 50,604 | | 4,291 | |
| 16 | マーケット・リスク | 1,163,880 | | 93,110 | |
| 17 | うち、標準的方式適用分 | 170,246 | | 13,619 | |
| 18 | うち、内部モデル方式適用分 | 993,634 | | 79,490 | |
| 19 | オペレーショナル・リスク | 1,006,898 | | 80,551 | |
| 20 | うち、基礎的手法適用分 | 164,375 | | 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 | | 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 | 218,903 | | 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 (スケールリングファクター適用後)* | 20,522,957 | | 1,641,836 | |

* 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。