

リスク・アセットの概要(2019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	
		2018年12月末	2018年9月末	2018年12月末	2018年9月末
1	信用リスク	12,998,965	13,135,981	1,098,278	1,109,903
2	うち、標準的手法適用分	310,932	298,109	24,874	23,848
3	うち、内部格付手法適用分	12,158,519	12,296,829	1,031,042	1,042,771
	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	15,453	15,519	1,236	1,241
	その他	514,059	525,523	41,124	42,041
4	カウンターパーティ信用リスク	787,682	733,633	64,300	59,891
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	251,612	232,794	21,321	19,728
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	409,682	375,779	32,774	30,062
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	41,792	42,935	3,343	3,434
	その他	84,594	82,124	6,860	6,665
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	216,491	364,077	18,358	30,873
	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	1,611,152	2,283,869	136,625	193,672
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	165,581	153,263	14,041	12,996
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	44,741	43,509	3,794	3,689
14	うち、内部格付手法における指定関数方式適用分	74,769	61,565	6,340	5,220
15	うち、標準的手法適用分	-	-	-	-
	うち、1,250%のリスク・ウェイト適用分	46,070	48,188	3,906	4,086
16	マーケット・リスク	1,326,080	1,125,470	106,086	90,037
17	うち、標準的方式適用分	21,291	19,683	1,703	1,574
18	うち、内部モデル方式適用分	1,304,788	1,105,786	104,383	88,462
19	オペレーショナル・リスク	993,538	993,538	79,483	79,483
20	うち、基礎的手法適用分	165,442	165,442	13,235	13,235
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	828,096	828,096	66,247	66,247
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	340,071	245,790	28,838	20,843
	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)*	19,325,145	19,971,261	1,546,011	1,597,700

* 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。