

リスク・アセットの概要(2023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	
		2022年12月末	2022年9月末	2022年12月末	2022年9月末
1	信用リスク	12,998,222	13,037,315	1,096,489	1,099,353
2	うち、標準的手法適用分	465,864	481,523	37,269	38,521
3	うち、内部格付手法適用分	11,798,335	11,743,370	1,000,498	995,837
	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	104,022	90,940	8,321	7,275
	その他	630,000	721,481	50,400	57,718
4	カウンターパーティ信用リスク	1,108,132	1,293,371	90,371	105,554
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	346,217	421,937	29,344	35,756
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	551,688	644,577	44,135	51,566
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	72,996	79,751	5,839	6,380
	その他	137,231	147,104	11,052	11,851
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	228,901	384,854	19,410	32,635
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)	2,117,318	1,273,152	169,385	101,852
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)	1,482,276	2,151,178	118,582	172,094
	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%)	1,303	1,762	104	140
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	338,631	416,099	27,090	33,287
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	319,682	399,947	25,574	31,995
14	うち、外部格付準拠方式適用分	18,744	15,904	1,499	1,272
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	205	247	16	19
16	マーケット・リスク	1,993,183	1,306,218	159,454	104,497
17	うち、標準的方式適用分	77,866	49,658	6,229	3,972
18	うち、内部モデル方式適用分	1,915,316	1,256,559	153,225	100,524
19	オペレーショナル・リスク	957,726	957,726	76,618	76,618
20	うち、基礎的手法適用分	211,754	211,754	16,940	16,940
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	745,971	745,971	59,677	59,677
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	675,067	676,956	57,245	57,405
	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)*	22,684,414	22,293,002	1,814,753	1,783,440

\* 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。