

リスク・アセットの概要(2021年3月期第1四半期)

【三井住友信託銀行】

(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	12,301,850	12,085,492	1,039,032	1,021,035
2	うち、標準的手法適用分	345,339	280,125	27,627	22,410
3	うち、内部格付手法適用分	11,434,223	11,290,809	969,622	957,460
	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残残存価額のエクスポージャー	48,810	59,850	3,904	4,788
	その他	473,476	454,706	37,878	36,376
4	カウンターパーティ信用リスク	1,176,172	1,201,970	96,013	98,122
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	379,487	392,916	32,168	33,304
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	650,636	663,072	52,050	53,045
	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	360,777	221,775	30,593	18,806
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)	994,986	861,670	79,598	68,933
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)	805,172	763,076	64,413	61,046
	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	1,288,541	1,325,398	103,083	106,031
17	うち、標準的方式適用分	12,826	13,585	1,026	1,086
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	860,710	860,710	68,856	68,856
20	うち、基礎的手法適用分	166,809	166,809	13,344	13,344
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	693,900	693,900	55,512	55,512
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	260,246	257,586	22,068	21,843
	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)*	19,119,407	18,657,616	1,529,552	1,492,609

\* 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。