

リスク・アセットの概要(2021年3月期第2四半期)

【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9月末	2020年6月末	2020年9月末	2020年6月末
1	信用リスク	12,116,740	12,301,850	1,023,301	1,039,032
2	うち、標準的手法適用分	348,974	345,339	27,917	27,627
3	うち、内部格付手法適用分	11,242,063	11,434,223	953,327	969,622
	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	62,402	48,810	4,992	3,904
	その他	463,299	473,476	37,063	37,878
4	カウンターパーティ信用リスク	1,213,814	1,176,172	99,088	96,013
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	389,420	379,487	33,012	32,168
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	666,708	650,636	53,336	52,050
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	52,555	57,611	4,204	4,608
	その他	105,129	88,437	8,534	7,185
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	249,395	360,777	21,148	30,593
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)	1,347,216	994,986	107,777	79,598
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)	842,419	805,172	67,393	64,413
	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%)	1,103	1,135	88	90
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	313,985	322,503	25,118	25,800
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	295,189	309,035	23,615	24,722
14	うち、外部格付準拠方式適用分	18,056	12,646	1,444	1,011
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	739	821	59	65
16	マーケット・リスク	1,321,748	1,288,541	105,739	103,083
17	うち、標準的方式適用分	12,277	12,826	982	1,026
18	うち、内部モデル方式適用分	1,309,470	1,275,714	104,757	102,057
19	オペレーショナル・リスク	878,468	860,710	70,277	68,856
20	うち、基礎的手法適用分	157,690	166,809	12,615	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	720,778	693,900	57,662	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	265,933	260,246	22,551	22,068
	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)*	19,281,057	19,119,407	1,542,484	1,529,552

\* 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。