

リスク・アセットの概要(2021年3月期第3四半期)

【三井住友信託銀行】

(単体・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12月末	2020年9月末	2020年12月末	2020年9月末
1	信用リスク	12,266,219	12,080,899	1,030,810	1,015,139
2	うち、標準的手法適用分	1,260	1,077	100	86
3	うち、内部格付手法適用分	10,315,117	10,138,987	874,721	859,786
	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	-	-	-	-
	その他	1,949,841	1,940,834	155,987	155,266
4	カウンターパーティ信用リスク	1,174,953	1,130,923	96,080	92,456
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	406,010	387,115	34,429	32,827
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	698,198	665,382	55,855	53,230
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	42,452	52,555	3,396	4,204
	その他	28,292	25,870	2,399	2,193
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	295,115	233,895	25,025	19,834
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)	1,306,908	1,347,216	104,552	107,777
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)	891,056	841,700	71,284	67,336
	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%)	1,020	1,103	81	88
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	209,605	232,170	16,768	18,573
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	187,817	214,114	15,025	17,129
14	うち、外部格付準拠方式適用分	21,787	18,056	1,743	1,444
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	0	0	0	0
16	マーケット・リスク	1,583,581	1,313,098	126,686	105,047
17	うち、標準的方式適用分	3,068	3,628	245	290
18	うち、内部モデル方式適用分	1,580,512	1,309,470	126,440	104,757
19	オペレーショナル・リスク	658,753	658,753	52,700	52,700
20	うち、基礎的手法適用分	428	428	34	34
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	658,324	658,324	52,665	52,665
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	157,529	157,547	13,358	13,360
	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)*	19,216,866	18,653,915	1,537,349	1,492,313

* 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。