

リスク・アセットの概要(2021年3月期)

【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	
		2021年3月末	2020年12月末	2021年3月末	2020年12月末
1	信用リスク	12,418,284	12,234,503	1,048,654	1,033,587
2	うち、標準的手法適用分	357,889	302,406	28,631	24,192
3	うち、内部格付手法適用分	11,498,202	11,422,274	975,047	968,608
	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	76,111	74,935	6,088	5,994
	その他	486,080	434,887	38,886	34,791
4	カウンターパーティ信用リスク	1,245,363	1,255,281	101,711	102,507
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	407,578	408,698	34,551	34,645
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	675,731	699,392	54,058	55,951
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	47,434	42,452	3,794	3,396
	その他	114,618	104,737	9,307	8,514
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	499,375	310,806	42,347	26,356
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)	1,054,083	1,306,908	84,326	104,552
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)	949,128	891,841	75,930	71,347
	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%)	1,091	1,020	87	81
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	309,080	288,373	24,726	23,069
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	291,351	265,924	23,308	21,273
14	うち、外部格付準拠方式適用分	17,132	21,787	1,370	1,743
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	597	661	47	52
16	マーケット・リスク	1,417,864	1,592,865	113,429	127,429
17	うち、標準的方式適用分	12,605	12,353	1,008	988
18	うち、内部モデル方式適用分	1,405,258	1,580,512	112,420	126,440
19	オペレーショナル・リスク	852,497	878,468	68,199	70,277
20	うち、基礎的手法適用分	148,187	157,690	11,854	12,615
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	704,309	720,778	56,344	57,662
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	284,402	273,535	24,117	23,195
	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)*	19,794,125	19,780,068	1,583,530	1,582,405

* 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。