

リスク・アセットの概要(2022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	
		2021年6月末	2021年3月末	2021年6月末	2021年3月末
1	信用リスク	12,143,593	12,418,284	1,025,448	1,048,654
2	うち、標準的手法適用分	327,708	357,889	26,216	28,631
3	うち、内部格付手法適用分	11,241,913	11,498,202	953,314	975,047
	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	88,088	76,111	7,047	6,088
	その他	485,883	486,080	38,870	38,886
4	カウンターパーティ信用リスク	1,201,249	1,245,363	98,118	101,711
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	394,208	407,578	33,417	34,551
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	632,289	675,731	50,583	54,058
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	47,618	47,434	3,809	3,794
	その他	127,132	114,618	10,308	9,307
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	343,259	499,375	29,108	42,347
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)	992,744	1,054,083	79,419	84,326
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)	964,150	949,128	77,132	75,930
	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%)	1,067	1,091	85	87
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	271,680	309,080	21,734	24,726
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	255,717	291,351	20,457	23,308
14	うち、外部格付準拠方式適用分	15,439	17,132	1,235	1,370
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	523	597	41	47
16	マーケット・リスク	1,708,100	1,417,864	136,648	113,429
17	うち、標準的方式適用分	11,748	12,605	939	1,008
18	うち、内部モデル方式適用分	1,696,352	1,405,258	135,708	112,420
19	オペレーショナル・リスク	852,497	852,497	68,199	68,199
20	うち、基礎的手法適用分	148,187	148,187	11,854	11,854
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	704,309	56,344	56,344
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	293,401	284,402	24,880	24,117
	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)*	19,509,687	19,794,125	1,560,775	1,583,530

* 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。