

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】**  
(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	
		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	12,116,077	12,381,768	1,018,053	1,040,123
2	うち、標準的手法適用分	1,149	1,106	91	88
3	うち、内部格付手法適用分	10,159,824	10,329,612	861,553	875,951
	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	1,955,102	2,051,049	156,408	164,083
4	カウンターパーティ信用リスク	1,099,304	1,155,749	89,961	94,542
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	391,620	405,097	33,209	34,352
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	631,348	674,527	50,507	53,962
	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	28,716	28,689	2,435	2,432
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	326,889	482,003	27,720	40,873
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)	963,620	948,627	77,089	75,890
	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	194,925	235,194	15,594	18,815
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	179,485	218,062	14,358	17,444
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	0	0	0	0
16	マーケット・リスク	1,698,657	1,407,899	135,892	112,631
17	うち、標準的方式適用分	2,305	2,640	184	211
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	657,321	657,321	52,585	52,585
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
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	657,321	657,321	52,585	52,585
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	157,664	157,826	13,369	13,383
	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)*	18,872,154	19,165,759	1,509,772	1,533,260

\* 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。