

リスク・アセットの概要(2022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 | |
| | | 2021年9月末 | 2021年6月末 | 2021年9月末 | 2021年6月末 |
| 1 | 信用リスク | 12,029,903 | 12,143,593 | 1,015,999 | 1,025,448 |
| 2 | うち、標準的手法適用分 | 303,358 | 327,708 | 24,268 | 26,216 |
| 3 | うち、内部格付手法適用分 | 11,168,200 | 11,241,913 | 947,063 | 953,314 |
| | 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 | 81,493 | 88,088 | 6,519 | 7,047 |
| | その他 | 476,850 | 485,883 | 38,148 | 38,870 |
| 4 | カウンターパーティ信用リスク | 1,224,634 | 1,201,249 | 99,986 | 98,118 |
| 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 | 396,544 | 394,208 | 33,618 | 33,417 |
| 6 | うち、期待エクスポージャー方式適用分 | - | - | - | - |
| | うち、CVAリスク | 654,517 | 632,289 | 52,361 | 50,583 |
| | うち、中央清算機関関連エクスポージャー | 48,017 | 47,618 | 3,841 | 3,809 |
| | その他 | 125,554 | 127,132 | 10,165 | 10,308 |
| 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 | 271,064 | 343,259 | 22,986 | 29,108 |
| 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) | 831,720 | 992,744 | 66,537 | 79,419 |
| 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) | 1,024,182 | 964,150 | 81,934 | 77,132 |
| | 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%) | 1,118 | 1,067 | 89 | 85 |
| 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 | 258,849 | 271,680 | 20,707 | 21,734 |
| 13 | うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分 | 245,083 | 255,717 | 19,606 | 20,457 |
| 14 | うち、外部格付準拠方式適用分 | 13,307 | 15,439 | 1,064 | 1,235 |
| 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 | 458 | 523 | 36 | 41 |
| 16 | マーケット・リスク | 1,645,144 | 1,708,100 | 131,611 | 136,648 |
| 17 | うち、標準的方式適用分 | 26,636 | 11,748 | 2,130 | 939 |
| 18 | うち、内部モデル方式適用分 | 1,618,508 | 1,696,352 | 129,480 | 135,708 |
| 19 | オペレーショナル・リスク | 819,530 | 852,497 | 65,562 | 68,199 |
| 20 | うち、基礎的手法適用分 | 137,014 | 148,187 | 10,961 | 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 | 682,516 | 704,309 | 54,601 | 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 | 311,337 | 293,401 | 26,401 | 24,880 |
| | 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)* | 19,147,719 | 19,509,687 | 1,531,817 | 1,560,775 |

* 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。