

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】

(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9月末	2021年6月末	2021年9月末	2021年6月末
1	信用リスク	11,966,409	12,116,077	1,005,667	1,018,053
2	うち、標準的手法適用分	1,087	1,149	86	91
3	うち、内部格付手法適用分	10,073,848	10,159,824	854,262	861,553
	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	1,891,473	1,955,102	151,317	156,408
4	カウンターパーティ信用リスク	1,121,645	1,099,304	91,746	89,961
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	394,546	391,620	33,457	33,209
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	653,823	631,348	52,305	50,507
	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	25,257	28,716	2,141	2,435
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	257,965	326,889	21,875	27,720
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)	1,023,589	963,620	81,887	77,089
	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	195,920	194,925	15,673	15,594
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	182,613	179,485	14,609	14,358
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	0	0	0	0
16	マーケット・リスク	1,635,685	1,698,657	130,854	135,892
17	うち、標準的方式適用分	17,176	2,305	1,374	184
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	629,938	657,321	50,395	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	629,938	657,321	50,395	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	165,364	157,664	14,022	13,369
	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)*	18,484,376	18,872,154	1,478,750	1,509,772

\* 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。