

リスク・アセットの概要(2022年3月期第3四半期)

【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12月末	2021年9月末	2021年12月末	2021年9月末
1	信用リスク	12,073,635	12,029,903	1,019,379	1,015,999
2	うち、標準的手法適用分	364,771	303,358	29,181	24,268
3	うち、内部格付手法適用分	11,143,409	11,168,200	944,961	947,063
	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	81,590	81,493	6,527	6,519
	その他	483,864	476,850	38,709	38,148
4	カウンターパーティ信用リスク	1,202,152	1,224,634	98,166	99,986
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	395,771	396,544	33,544	33,618
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	639,999	654,517	51,199	52,361
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	48,274	48,017	3,861	3,841
	その他	118,106	125,554	9,560	10,165
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	270,186	271,064	22,911	22,986
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)	815,026	831,720	65,202	66,537
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)	1,084,667	1,024,182	86,773	81,934
	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%)	1,087	1,118	86	89
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	287,204	258,849	22,976	20,707
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	267,813	245,083	21,425	19,606
14	うち、外部格付準拠方式適用分	18,984	13,307	1,518	1,064
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	406	458	32	36
16	マーケット・リスク	1,833,586	1,645,144	146,686	131,611
17	うち、標準的方式適用分	14,637	26,636	1,170	2,130
18	うち、内部モデル方式適用分	1,818,949	1,618,508	145,515	129,480
19	オペレーショナル・リスク	819,530	819,530	65,562	65,562
20	うち、基礎的手法適用分	137,014	137,014	10,961	10,961
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	682,516	54,601	54,601
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	320,839	311,337	27,207	26,401
	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)*	19,436,911	19,147,719	1,554,952	1,531,817

* 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。