

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】

(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12月末	2021年9月末	2021年12月末	2021年9月末
1	信用リスク	11,914,025	11,966,409	1,001,334	1,005,667
2	うち、標準的手法適用分	862	1,087	69	86
3	うち、内部格付手法適用分	10,044,228	10,073,848	851,750	854,262
	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	1,868,934	1,891,473	149,514	151,317
4	カウンターパーティ信用リスク	1,102,843	1,121,645	90,221	91,746
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	392,029	394,546	33,244	33,457
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	639,222	653,823	51,137	52,305
	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	23,317	25,257	1,977	2,141
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	251,838	257,965	21,355	21,875
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)	1,084,021	1,023,589	86,721	81,887
	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	227,225	195,920	18,178	15,673
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	208,241	182,613	16,659	14,609
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	0	0	0	0
16	マーケット・リスク	1,822,135	1,635,685	145,770	130,854
17	うち、標準的方式適用分	3,186	17,176	254	1,374
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	629,938	629,938	50,395	50,395
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	629,938	50,395	50,395
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	165,366	165,364	14,023	14,022
	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)*	18,666,117	18,484,376	1,493,289	1,478,750

\* 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。