

リスク・アセットの概要(2022年3月期)

【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	
		2022年3月末	2021年12月末	2022年3月末	2021年12月末
1	信用リスク	12,355,554	12,073,635	1,042,867	1,019,379
2	うち、標準的手法適用分	396,270	364,771	31,701	29,181
3	うち、内部格付手法適用分	11,338,133	11,143,409	961,473	944,961
	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	66,079	81,590	5,286	6,527
	その他	555,070	483,864	44,405	38,709
4	カウンターパーティ信用リスク	1,271,434	1,202,152	103,802	98,166
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	408,955	395,771	34,671	33,544
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	659,988	639,999	52,799	51,199
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	55,007	48,274	4,400	3,861
	その他	147,482	118,106	11,930	9,560
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	207,882	270,186	17,628	22,911
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)	893,938	815,026	71,515	65,202
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)	1,228,579	1,084,667	98,286	86,773
	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%)	1,448	1,087	115	86
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	357,010	287,204	28,560	22,976
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	341,805	267,813	27,344	21,425
14	うち、外部格付準拠方式適用分	14,852	18,984	1,188	1,518
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	352	406	28	32
16	マーケット・リスク	1,252,756	1,833,586	100,220	146,686
17	うち、標準的方式適用分	17,900	14,637	1,432	1,170
18	うち、内部モデル方式適用分	1,234,856	1,818,949	98,788	145,515
19	オペレーショナル・リスク	806,414	819,530	64,513	65,562
20	うち、基礎的手法適用分	129,679	137,014	10,374	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	676,735	682,516	54,138	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	468,441	320,839	39,723	27,207
	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)*	19,590,422	19,436,911	1,567,233	1,554,952

* 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。