

リスク・アセットの概要(2022年3月期)

【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	
		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	12,290,526	11,914,025	1,032,083	1,001,334
2	うち、標準的手法適用分	827	862	66	69
3	うち、内部格付手法適用分	10,175,272	10,044,228	862,863	851,750
	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	2,114,426	1,868,934	169,154	149,514
4	カウンターパーティ信用リスク	1,149,099	1,102,843	94,014	90,221
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	407,204	392,029	34,530	33,244
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	659,325	639,222	52,746	51,137
	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	27,562	23,317	2,337	1,977
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	186,018	251,838	15,774	21,355
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)	1,228,015	1,084,021	98,241	86,721
	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	289,158	227,225	23,132	18,178
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	274,306	208,241	21,944	16,659
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	0	0	0	0
16	マーケット・リスク	1,240,649	1,822,135	99,251	145,770
17	うち、標準的方式適用分	5,793	3,186	463	254
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	631,520	629,938	50,521	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	631,520	629,938	50,521	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	243,170	165,366	20,620	14,023
	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)*	18,815,901	18,666,117	1,505,272	1,493,289

* 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。