

リスク・アセットの概要(2023年3月期第1四半期)

【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	
		2022年6月末	2022年3月末	2022年6月末	2022年3月末
1	信用リスク	12,520,805	12,355,554	1,056,076	1,042,867
2	うち、標準的手法適用分	449,111	396,270	35,928	31,701
3	うち、内部格付手法適用分	11,335,744	11,338,133	961,271	961,473
	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	85,208	66,079	6,816	5,286
	その他	650,740	555,070	52,059	44,405
4	カウンターパーティ信用リスク	1,293,327	1,271,434	105,589	103,802
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	418,742	408,955	35,496	34,671
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	651,663	659,988	52,133	52,799
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	67,871	55,007	5,429	4,400
	その他	155,050	147,482	12,529	11,930
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	409,058	207,882	34,688	17,628
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)	759,247	893,938	60,739	71,515
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)	1,401,029	1,228,579	112,082	98,286
	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%)	1,683	1,448	134	115
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	377,244	357,010	30,179	28,560
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	360,419	341,805	28,833	27,344
14	うち、外部格付準拠方式適用分	16,529	14,852	1,322	1,188
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	295	352	23	28
16	マーケット・リスク	1,368,558	1,252,756	109,484	100,220
17	うち、標準的方式適用分	20,082	17,900	1,606	1,432
18	うち、内部モデル方式適用分	1,348,475	1,234,856	107,878	98,788
19	オペレーショナル・リスク	806,414	806,414	64,513	64,513
20	うち、基礎的手法適用分	129,679	129,679	10,374	10,374
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	676,735	54,138	54,138
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	496,481	468,441	42,101	39,723
	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)*	20,194,869	19,590,422	1,615,589	1,567,233

* 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。