

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】

(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	12,324,872	12,290,526	1,035,243	1,032,083
2	うち、標準的手法適用分	1,077	827	86	66
3	うち、内部格付手法適用分	10,261,275	10,175,272	870,156	862,863
	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	2,062,520	2,114,426	165,001	169,154
4	カウンターパーティ信用リスク	1,161,137	1,149,099	95,013	94,014
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	415,944	407,204	35,272	34,530
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	651,078	659,325	52,086	52,746
	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	26,242	27,562	2,225	2,337
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	394,966	186,018	33,493	15,774
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)	1,400,444	1,228,015	112,035	98,241
	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	315,937	289,158	25,274	23,132
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	299,407	274,306	23,952	21,944
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	0	0	0	0
16	マーケット・リスク	1,355,051	1,240,649	108,404	99,251
17	うち、標準的方式適用分	6,575	5,793	526	463
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	631,520	631,520	50,521	50,521
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	631,520	50,521	50,521
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	265,348	243,170	22,501	20,620
	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)*	19,292,037	18,815,901	1,543,363	1,505,272

* 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。