

リスク・アセットの概要(2023年3月期第2四半期)

【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9月末	2022年6月末	2022年9月末	2022年6月末
1	信用リスク	12,961,090	12,520,805	1,093,228	1,056,076
2	うち、標準的手法適用分	465,124	449,111	37,209	35,928
3	うち、内部格付手法適用分	11,737,770	11,335,744	995,362	961,271
	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	90,940	85,208	7,275	6,816
	その他	667,255	650,740	53,380	52,059
4	カウンターパーティ信用リスク	1,292,523	1,293,327	105,486	105,589
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	421,391	418,742	35,712	35,496
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	644,275	651,663	51,542	52,133
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	79,751	67,871	6,380	5,429
	その他	147,104	155,050	11,851	12,529
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	367,549	409,058	31,168	34,688
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)	1,273,213	759,247	101,857	60,739
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)	2,037,500	1,401,029	163,000	112,082
	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%)	1,762	1,683	140	134
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	416,099	377,244	33,287	30,179
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	399,947	360,419	31,995	28,833
14	うち、外部格付準拠方式適用分	15,904	16,529	1,272	1,322
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	247	295	19	23
16	マーケット・リスク	1,285,223	1,368,558	102,817	109,484
17	うち、標準的方式適用分	28,663	20,082	2,293	1,606
18	うち、内部モデル方式適用分	1,256,559	1,348,475	100,524	107,878
19	オペレーショナル・リスク	811,103	806,414	64,888	64,513
20	うち、基礎的手法適用分	131,098	129,679	10,487	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	680,005	676,735	54,400	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	514,630	496,481	43,640	42,101
	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)*	21,743,948	20,194,869	1,739,515	1,615,589

* 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。