

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<br>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。