

リスク・アセットの概要(2023年3月期第3四半期)

【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12月末	2022年9月末	2022年12月末	2022年9月末
1	信用リスク	12,918,991	12,961,090	1,090,125	1,093,228
2	うち、標準的手法適用分	451,701	465,124	36,136	37,209
3	うち、内部格付手法適用分	11,793,022	11,737,770	1,000,048	995,362
	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	104,022	90,940	8,321	7,275
	その他	570,244	667,255	45,619	53,380
4	カウンターパーティ信用リスク	1,107,554	1,292,523	90,325	105,486
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	345,843	421,391	29,314	35,712
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	551,483	644,275	44,118	51,542
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	72,996	79,751	5,839	6,380
	その他	137,231	147,104	11,052	11,851
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	212,395	367,549	18,011	31,168
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)	2,117,383	1,273,213	169,390	101,857
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)	1,368,055	2,037,500	109,444	163,000
	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%)	1,303	1,762	104	140
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	338,631	416,099	27,090	33,287
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	319,682	399,947	25,574	31,995
14	うち、外部格付準拠方式適用分	18,744	15,904	1,499	1,272
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	205	247	16	19
16	マーケット・リスク	1,949,854	1,285,223	155,988	102,817
17	うち、標準的方式適用分	34,537	28,663	2,762	2,293
18	うち、内部モデル方式適用分	1,915,316	1,256,559	153,225	100,524
19	オペレーショナル・リスク	811,103	811,103	64,888	64,888
20	うち、基礎的手法適用分	131,098	131,098	10,487	10,487
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	680,005	54,400	54,400
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	518,025	514,630	43,928	43,640
	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)*	22,116,217	21,743,948	1,769,297	1,739,515

\* 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。