

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】

(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	12,715,587	12,823,173	1,068,256	1,076,829
2	うち、標準的手法適用分	907	922	72	73
3	うち、内部格付手法適用分	10,627,081	10,620,008	901,176	900,576
	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	2,087,598	2,202,241	167,007	176,179
4	カウンターパーティ信用リスク	981,718	1,157,022	80,257	94,645
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	342,851	416,803	29,073	35,344
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	550,465	643,194	44,037	51,455
	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	15,405	17,273	1,306	1,464
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	190,003	348,378	16,112	29,542
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)	1,367,333	2,036,840	109,386	162,947
	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	270,485	347,861	21,638	27,828
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	251,741	331,957	20,139	26,556
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	0	0	0	0
16	マーケット・リスク	1,930,947	1,270,454	154,475	101,636
17	うち、標準的方式適用分	15,630	13,894	1,250	1,111
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	628,846	628,846	50,307	50,307
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	628,846	628,846	50,307	50,307
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	276,268	271,143	23,427	22,992
	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)*	21,166,974	20,859,113	1,693,357	1,668,729

\* 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。