

リスク・アセットの概要 (2023年3月期)

【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	
		2023年3月末	2022年12月末	2023年3月末	2022年12月末
1	信用リスク	13,446,715	12,918,991	1,134,377	1,090,125
2	うち、標準的手法適用分	540,033	451,701	43,202	36,136
3	うち、内部格付手法適用分	12,216,740	11,793,022	1,035,979	1,000,048
	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	138,902	104,022	11,112	8,321
	その他	551,038	570,244	44,083	45,619
4	カウンターパーティ信用リスク	1,234,326	1,107,554	100,608	90,325
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	375,138	345,843	31,795	29,314
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	644,308	551,483	51,544	44,118
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	76,398	72,996	6,111	5,839
	その他	138,481	137,231	11,156	11,052
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	279,851	212,395	23,731	18,011
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)	1,987,297	2,117,383	158,983	169,390
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)	1,561,034	1,368,055	124,882	109,444
	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%)	1,311	1,303	104	104
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	320,847	338,631	25,667	27,090
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	303,454	319,682	24,276	25,574
14	うち、外部格付準拠方式適用分	17,232	18,744	1,378	1,499
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	160	205	12	16
16	マーケット・リスク	1,794,366	1,949,854	143,549	155,988
17	うち、標準的方式適用分	38,300	34,537	3,064	2,762
18	うち、内部モデル方式適用分	1,756,065	1,915,316	140,485	153,225
19	オペレーショナル・リスク	831,832	811,103	66,546	64,888
20	うち、基礎的手法適用分	132,991	131,098	10,639	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	698,841	680,005	55,907	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	407,314	518,025	34,540	43,928
	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)*	22,662,408	22,116,217	1,812,992	1,769,297

* 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。