

リスク・アセットの概要 (2023年3月期)

【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	
		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	13,326,102	12,715,587	1,118,471	1,068,256
2	うち、標準的手法適用分	844	907	67	72
3	うち、内部格付手法適用分	10,913,090	10,627,081	925,430	901,176
	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	2,412,167	2,087,598	192,973	167,007
4	カウンターパーティ信用リスク	1,107,530	981,718	90,463	80,257
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	371,522	342,851	31,505	29,073
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	643,376	550,465	51,470	44,037
	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	16,232	15,405	1,376	1,306
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	175,413	190,003	14,875	16,112
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)	1,560,189	1,367,333	124,815	109,386
	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	266,300	270,485	21,304	21,638
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	249,067	251,741	19,925	20,139
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	0	0	0	0
16	マーケット・リスク	1,775,223	1,930,947	142,017	154,475
17	うち、標準的方式適用分	19,158	15,630	1,532	1,250
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	645,616	628,846	51,649	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	645,616	628,846	51,649	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	224,506	276,268	19,038	23,427
	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)*	21,771,535	21,166,974	1,741,722	1,693,357

* 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。