

リスク・アセットの概要 (2024年3月期第1四半期)

【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	
		2023年6月末	2023年3月末	2023年6月末	2023年3月末
1	信用リスク	13,873,575	13,446,715	1,169,527	1,134,377
2	うち、標準的手法適用分	508,184	540,033	40,654	43,202
3	うち、内部格付手法適用分	12,425,237	12,216,740	1,053,660	1,035,979
	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	282,065	138,902	22,565	11,112
	その他	658,087	551,038	52,647	44,083
4	カウンターパーティ信用リスク	1,332,367	1,234,326	108,764	100,608
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	438,177	375,138	37,136	31,795
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	681,200	644,308	54,496	51,544
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	62,007	76,398	4,960	6,111
	その他	150,982	138,481	12,171	11,156
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	342,068	279,851	29,007	23,731
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)	2,013,779	1,987,297	161,102	158,983
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)	1,661,454	1,561,034	132,916	124,882
	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%)	1,247	1,311	99	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	345,492	320,847	27,639	25,667
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	329,183	303,454	26,334	24,276
14	うち、外部格付準拠方式適用分	16,188	17,232	1,295	1,378
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	119	160	9	12
16	マーケット・リスク	1,560,212	1,794,366	124,817	143,549
17	うち、標準的方式適用分	45,594	38,300	3,647	3,064
18	うち、内部モデル方式適用分	1,514,618	1,756,065	121,169	140,485
19	オペレーショナル・リスク	831,832	831,832	66,546	66,546
20	うち、基礎的手法適用分	132,991	132,991	10,639	10,639
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	698,841	55,907	55,907
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	354,185	407,314	30,034	34,540
	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)*	23,130,693	22,662,408	1,850,455	1,812,992

* 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。