

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】

(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	13,734,736	13,326,102	1,152,599	1,118,471
2	うち、標準的手法適用分	835	844	66	67
3	うち、内部格付手法適用分	11,212,711	10,913,090	950,837	925,430
	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	2,521,189	2,412,167	201,695	192,973
4	カウンターパーティ信用リスク	1,195,186	1,107,530	97,789	90,463
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	433,708	371,522	36,778	31,505
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	680,193	643,376	54,415	51,470
	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	19,275	16,232	1,634	1,376
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	301,214	175,413	25,542	14,875
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)	1,660,526	1,560,189	132,842	124,815
	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	279,118	266,300	22,329	21,304
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	262,929	249,067	21,034	19,925
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	0	0	0	0
16	マーケット・リスク	1,534,939	1,775,223	122,795	142,017
17	うち、標準的方式適用分	20,320	19,158	1,625	1,532
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	645,616	645,616	51,649	51,649
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	645,616	51,649	51,649
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	169,642	224,506	14,385	19,038
	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)*	22,264,199	21,771,535	1,781,135	1,741,722

* 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。