

リスク・アセットの概要 (2024年3月期第2四半期)

【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9月末	2023年6月末	2023年9月末	2023年6月末
1	信用リスク	14,246,441	13,873,575	1,200,864	1,169,527
2	うち、標準的手法適用分	525,819	508,184	42,065	40,654
3	うち、内部格付手法適用分	12,739,430	12,425,237	1,080,303	1,053,660
	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	279,946	282,065	22,395	22,565
	その他	701,244	658,087	56,099	52,647
4	カウンターパーティ信用リスク	1,392,833	1,332,367	113,751	108,764
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	468,352	438,177	39,694	37,136
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	690,362	681,200	55,229	54,496
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	70,897	62,007	5,671	4,960
	その他	163,220	150,982	13,155	12,171
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	302,133	342,068	25,620	29,007
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)	1,844,440	2,013,779	147,555	161,102
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)	1,734,202	1,661,454	138,736	132,916
	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%)	841	1,247	67	99
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	371,322	345,492	29,705	27,639
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	355,787	329,183	28,463	26,334
14	うち、外部格付準拠方式適用分	15,451	16,188	1,236	1,295
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	83	119	6	9
16	マーケット・リスク	1,770,141	1,560,212	141,611	124,817
17	うち、標準的方式適用分	67,059	45,594	5,364	3,647
18	うち、内部モデル方式適用分	1,703,082	1,514,618	136,246	121,169
19	オペレーショナル・リスク	881,082	831,832	70,486	66,546
20	うち、基礎的手法適用分	142,736	132,991	11,418	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	738,346	698,841	59,067	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	299,807	354,185	25,423	30,034
	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)*	23,672,783	23,130,693	1,893,822	1,850,455

* 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。