

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】

(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<br>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   | 13,970,573 | 13,734,736 | 1,172,784 | 1,152,599 |
| 2               | うち、標準的手法適用分                                       | 625        | 835        | 50        | 66        |
| 3               | うち、内部格付手法適用分                                      | 11,487,234 | 11,212,711 | 974,117   | 950,837   |
|                 | 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   | 2,482,714  | 2,521,189  | 198,617   | 201,695   |
| 4               | カウンターパーティ信用リスク                                    | 1,244,998  | 1,195,186  | 101,923   | 97,789    |
| 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                             | 463,619    | 433,708    | 39,314    | 36,778    |
| 6               | うち、期待エクスポージャー方式適用分                                | -          | -          | -         | -         |
|                 | うち、CVAリスク   | 690,085    | 680,193    | 55,206    | 54,415    |
|                 | 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   | 20,396     | 19,275     | 1,729     | 1,634     |
| 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                        | 257,302    | 301,214    | 21,819    | 25,542    |
| 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)         | 1,733,183  | 1,660,526  | 138,654   | 132,842   |
|                 | 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                | 293,751    | 279,118    | 23,500    | 22,329    |
| 13              | うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分                          | 278,299    | 262,929    | 22,263    | 21,034    |
| 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                             | 0          | 0          | 0         | 0         |
| 16              | マーケット・リスク   | 1,743,980  | 1,534,939  | 139,518   | 122,795   |
| 17              | うち、標準的方式適用分                                       | 40,898     | 20,320     | 3,271     | 1,625     |
| 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                                      | 684,403    | 645,616    | 54,752    | 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                                     | 684,403    | 645,616    | 54,752    | 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                  | 152,137    | 169,642    | 12,901    | 14,385    |
|                 | 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)*                             | 22,668,454 | 22,264,199 | 1,813,476 | 1,781,135 |

\* 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。