

リスク・アセットの概要 (2024年3月期第3四半期)

【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12月末	2023年9月末	2023年12月末	2023年9月末
1	信用リスク	14,350,035	14,246,441	1,209,551	1,200,864
2	うち、標準的手法適用分	563,707	525,819	45,096	42,065
3	うち、内部格付手法適用分	12,822,540	12,739,430	1,087,351	1,080,303
	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	279,884	279,946	22,390	22,395
	その他	683,903	701,244	54,712	56,099
4	カウンターパーティ信用リスク	1,201,646	1,392,833	97,996	113,751
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	379,328	468,352	32,152	39,694
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	605,663	690,362	48,453	55,229
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	71,014	70,897	5,681	5,671
	その他	145,639	163,220	11,710	13,155
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	311,530	302,133	26,417	25,620
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)	1,669,835	1,844,440	133,586	147,555
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)	1,757,574	1,734,202	140,605	138,736
	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%)	800	841	64	67
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	404,439	371,322	32,355	29,705
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	383,178	355,787	30,654	28,463
14	うち、外部格付準拠方式適用分	21,214	15,451	1,697	1,236
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	46	83	3	6
16	マーケット・リスク	1,713,471	1,770,141	137,077	141,611
17	うち、標準的方式適用分	65,110	67,059	5,208	5,364
18	うち、内部モデル方式適用分	1,648,361	1,703,082	131,868	136,246
19	オペレーショナル・リスク	881,082	881,082	70,486	70,486
20	うち、基礎的手法適用分	142,736	142,736	11,418	11,418
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	738,346	59,067	59,067
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	310,740	299,807	26,350	25,423
	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)*	23,431,159	23,672,783	1,874,492	1,893,822

* 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。