

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】

(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	14,155,065	13,970,573	1,188,030	1,172,784
2	うち、標準的手法適用分	1,073	625	85	50
3	うち、内部格付手法適用分	11,588,534	11,487,234	982,707	974,117
	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	2,565,458	2,482,714	205,236	198,617
4	カウンターパーティ信用リスク	1,064,289	1,244,998	87,007	101,923
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	376,020	463,619	31,886	39,314
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	604,914	690,085	48,393	55,206
	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	12,339	20,396	1,046	1,729
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	266,263	257,302	22,579	21,819
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)	1,756,629	1,733,183	140,530	138,654
	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	314,101	293,751	25,128	23,500
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	292,886	278,299	23,430	22,263
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	0	0	0	0
16	マーケット・リスク	1,688,761	1,743,980	135,100	139,518
17	うち、標準的方式適用分	40,400	40,898	3,232	3,271
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	684,403	684,403	54,752	54,752
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	684,403	54,752	54,752
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	152,146	152,137	12,902	12,901
	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)*	22,496,014	22,668,454	1,799,681	1,813,476

* 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。