

リスク・アセットの概要(2024年3月期)

【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	
		2024年3月末	2023年12月末	2024年3月末	2023年12月末
1	信用リスク	15,760,902		1,260,872	
2	うち、標準的手法適用分	512,447		40,995	
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	10,858,672		868,693	
4	うち、スロッシング・クライテリア適用分	799,142		63,931	
5	うち、先進的内部格付手法適用分	2,512,404		200,992	
	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	295,966		23,677	
	その他	782,267		62,581	
6	カウンターパーティ信用リスク	456,883		36,550	
7	うち、SA-CCR適用分	417,414		33,393	
8	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—		—	
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	7,986		638	
9	その他	31,482		2,518	
10	CVAリスク	512,063		40,965	
	うち、SA-CVA適用分	—		—	
	うち、完全なBA-CVA適用分	512,063		40,965	
	うち、限定的なBA-CVA適用分	—		—	
11	経過措置により適用されるマーケット・ベース方式に基づく株式等エクスポージャー	423,203		33,856	
12	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(レック・スルー方式)	1,634,100		130,728	
13	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)	1,474,817		117,985	
	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%)	—		—	
14	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1250%)	746		59	
15	未決済取引	—		—	
16	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	438,462		35,076	
17	うち、内部格付手法準拠方式適用分	411,818		32,945	
18	うち、外部格付準拠方式適用分又は内部評価方式適用分	26,613		2,129	
19	うち、標準的手法準拠方式適用分	—		—	
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	30		2	
20	マーケット・リスク	990,531		79,242	
21	うち、標準的方式適用分	990,531		79,242	
22	うち、内部モデル方式適用分	—		—	
	うち、簡易的方式適用分	—		—	
23	勘定間の振替分	—		—	
24	オペレーショナル・リスク	1,060,031		84,802	
25	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	322,631		25,810	
26	フロア調整	—		—	
27	合計	23,074,373		1,845,949	

(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	
		2024年3月末	2023年12月末	2024年3月末	2023年12月末
1	信用リスク		14,350,035		1,209,551
2	うち、標準的手法適用分		563,707		45,096
3	うち、内部格付手法適用分		12,822,540		1,087,351
	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		22,390
	その他		683,903		54,712
4	カウンターパーティ信用リスク		1,201,646		97,996
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		32,152
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		48,453
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー		71,014		5,681
	その他		145,639		11,710
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		26,417
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(リスク・スルー方式)		1,669,835		133,586
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		140,605
	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		64
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		32,355
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		30,654
14	うち、外部格付準拠方式適用分		21,214		1,697
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		3
16	マーケット・リスク		1,713,471		137,077
17	うち、標準的方式適用分		65,110		5,208
18	うち、内部モデル方式適用分		1,648,361		131,868
19	オペレーショナル・リスク		881,082		70,486
20	うち、基礎的手法適用分		142,736		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		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		26,350
	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		1,874,492

* 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。