

リスク・アセットの概要(2024年3月期)

【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	
		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	15,832,177		1,266,574	
2	うち、標準的手法適用分	7,947		635	
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	9,623,638		769,891	
4	うち、スロッシング・クライテリア適用分	796,701		63,736	
5	うち、先進的内部格付手法適用分	2,493,555		199,484	
	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	2,910,334		232,826	
6	カウンターパーティ信用リスク	435,457		34,836	
7	うち、SA-CCR適用分	404,992		32,399	
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	22,478		1,798	
10	CVAリスク	507,936		40,634	
	うち、SA-CVA適用分	—		—	
	うち、完全なBA-CVA適用分	507,936		40,634	
	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	354,177		28,334	
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)	1,473,928		117,914	
	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	389,731		31,178	
17	うち、内部格付手法準拠方式適用分	363,117		29,049	
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	0		0	
20	マーケット・リスク	970,326		77,626	
21	うち、標準的方式適用分	970,326		77,626	
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	780,881		62,470	
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	152,268		12,181	
26	フロア調整	—		—	
27	合計	22,531,732		1,802,538	

(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		14,155,065		1,188,030
2	うち、標準的手法適用分		1,073		85
3	うち、内部格付手法適用分		11,588,534		982,707
	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		205,236
4	カウンターパーティ信用リスク		1,064,289		87,007
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		31,886
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		48,393
	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		12,339		1,046
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		22,579
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)		1,756,629		140,530
	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		314,101		25,128
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		23,430
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		0		0
16	マーケット・リスク		1,688,761		135,100
17	うち、標準的方式適用分		40,400		3,232
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		684,403		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		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		12,902
	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		1,799,681

* 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。