

リスク・アセットの概要 (2025年3月期第1四半期)

【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	
		2024年6月末	2024年3月末	2024年6月末	2024年3月末
1	信用リスク	15,582,357	15,832,177	1,246,588	1,266,574
2	うち、標準的手法適用分	8,316	7,947	665	635
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	9,543,403	9,623,638	763,472	769,891
4	うち、スロットティング・クライテリア適用分	833,830	796,701	66,706	63,736
5	うち、先進的内部格付手法適用分	2,566,985	2,493,555	205,358	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	2,629,821	2,910,334	210,385	232,826
6	カウンターパーティ信用リスク	523,869	435,457	41,909	34,836
7	うち、SA-CCR適用分	476,021	404,992	38,081	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	25,067	7,986	2,005	638
9	その他	22,781	22,478	1,822	1,798
10	CVAリスク	572,753	507,936	45,820	40,634
	うち、SA-CVA適用分	—	—	—	—
	うち、完全なBA-CVA適用分	572,753	507,936	45,820	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	376,902	354,177	30,152	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)	1,801,617	1,634,100	144,129	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)	1,595,595	1,473,928	127,647	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%)	718	746	57	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	513,713	389,731	41,097	31,178
17	うち、内部格付手法準拠方式適用分	472,936	363,117	37,834	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	40,776	26,613	3,262	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	0	0
20	マーケット・リスク	1,127,096	970,326	90,167	77,626
21	うち、標準的方式適用分	1,127,096	970,326	90,167	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	780,881	62,470	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	152,403	152,268	12,192	12,181
26	フロア調整	—	—	—	—
27	合計	23,027,909	22,531,732	1,842,232	1,802,538