

リスク・アセットの概要(2025年3月期第2四半期)

【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	
		2024年9月末	2024年6月末	2024年9月末	2024年6月末
1	信用リスク	14,700,025	15,499,921	1,176,002	1,239,993
2	うち、標準的手法適用分	541,451	536,435	43,316	42,914
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	10,154,111	10,704,553	812,328	856,364
4	うち、スロッシング・クライテリア適用分	765,370	834,808	61,229	66,784
5	うち、先進的内部格付手法適用分	2,341,209	2,566,985	187,296	205,358
	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	355,193	326,735	28,415	26,138
	その他	542,688	530,402	43,415	42,432
6	カウンターパーティ信用リスク	406,290	544,359	32,503	43,548
7	うち、SA-CCR適用分	352,430	486,926	28,194	38,954
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	21,985	25,067	1,758	2,005
9	その他	31,874	32,365	2,549	2,589
10	CVAリスク	465,680	589,328	37,254	47,146
	うち、SA-CVA適用分	—	—	—	—
	うち、完全なBA-CVA適用分	465,680	589,328	37,254	47,146
	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	453,333	457,608	36,266	36,608
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(リスク・スルー方式)	1,620,968	1,801,617	129,677	144,129
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(マंडート方式)	1,487,051	1,596,601	118,964	127,728
	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%)	424	718	33	57
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	458,053	561,772	36,644	44,941
17	うち、内部格付手法準拠方式適用分	432,277	520,978	34,582	41,678
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	25,762	40,776	2,060	3,262
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	13	18	1	1
20	マーケット・リスク	1,023,431	1,147,214	81,874	91,777
21	うち、標準的方式適用分	1,023,431	1,147,214	81,874	91,777
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	1,237,876	1,060,031	99,030	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	342,745	331,889	27,419	26,551
26	フロア調整	—	—	—	—
27	合計	22,195,880	23,591,062	1,775,670	1,887,285