

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】

(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	14,594,176	15,582,357	1,167,534	1,246,588
2	うち、標準的手法適用分	6,801	8,316	544	665
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	9,040,484	9,543,403	723,238	763,472
4	うち、スロッシング・クライテリア適用分	764,418	833,830	61,153	66,706
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	—	—	—	—
	その他	2,441,261	2,629,821	195,300	210,385
6	カウンターパーティ信用リスク	385,008	523,869	30,800	41,909
7	うち、SA-CCR適用分	343,855	476,021	27,508	38,081
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	19,167	22,781	1,533	1,822
10	CVAリスク	463,952	572,753	37,116	45,820
	うち、SA-CVA適用分	—	—	—	—
	うち、完全なBA-CVA適用分	463,952	572,753	37,116	45,820
	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	369,491	376,902	29,559	30,152
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(マンドート方式)	1,485,869	1,595,595	118,869	127,647
	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	410,466	513,713	32,837	41,097
17	うち、内部格付手法準拠方式適用分	384,703	472,936	30,776	37,834
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	0	0	0	0
20	マーケット・リスク	993,793	1,127,096	79,503	90,167
21	うち、標準的方式適用分	993,793	1,127,096	79,503	90,167
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	927,811	780,881	74,224	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	152,291	152,403	12,183	12,192
26	フロア調整	—	—	—	—
27	合計	21,404,254	23,027,909	1,712,340	1,842,232