

リスク・アセットの概要(2018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	
		2018年3月末	2017年12月末	2018年3月末	2017年12月末
1	信用リスク	13,676,818		1,148,991	
2	うち、標準的手法適用分	921		73	
3	うち、内部格付手法適用分	11,426,339		968,953	
	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	2,249,557		179,964	
4	カウンター・パーティ信用リスク	661,357		54,086	
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	228,300		19,359	
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-		-	
	うち、CVAリスク	389,662		31,173	
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	26,351		2,108	
	その他	17,042		1,445	
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	238,803		20,250	
	複数の資産及び取引を裏付けとするエクスポージャー	-		-	
	信用リスク・アセットのみなし計算が適用されるエクスポージャー	2,417,814		205,030	
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	122,223		10,364	
13	うち、内部格付手法における外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分	31,147		2,641	
14	うち、内部格付手法における指定関数方式適用分	42,207		3,579	
15	うち、標準的手法適用分	-		-	
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	48,868		4,144	
16	マーケット・リスク	1,148,998		91,919	
17	うち、標準的方式適用分	155,363		12,429	
18	うち、内部モデル方式適用分	993,634		79,490	
19	オペレーショナル・リスク	731,276		58,502	
20	うち、基礎的手法適用分	428		34	
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	730,847		58,467	
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	132,290		11,218	
	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)*	20,004,551		1,600,364	

* 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。