

リスク・アセットの概要(2019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	
		2018年6月末	2018年3月末	2018年6月末	2018年3月末
1	信用リスク	13,319,094	13,676,818	1,119,129	1,148,991
2	うち、標準的手法適用分	1,417	921	113	73
3	うち、内部格付手法適用分	11,167,156	11,426,339	946,974	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	2,150,520	2,249,557	172,041	179,964
4	カウンターパーティ信用リスク	614,075	661,357	50,226	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	211,545	228,300	17,939	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	354,368	389,662	28,349	31,173
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	30,447	26,351	2,435	2,108
	その他	17,713	17,042	1,502	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	311,285	238,803	26,396	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	2,342,822	2,417,814	198,671	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	122,405	122,223	10,379	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	35,122	31,147	2,978	2,641
14	うち、内部格付手法における指定関数方式適用分	39,081	42,207	3,314	3,579
15	うち、標準的手法適用分	-	-	-	-
	うち、1,250%のリスク・ウェイト適用分	48,201	48,868	4,087	4,144
16	マーケット・リスク	1,225,975	1,148,998	98,078	91,919
17	うち、標準的方式適用分	151,089	155,363	12,087	12,429
18	うち、内部モデル方式適用分	1,074,886	993,634	85,990	79,490
19	オペレーショナル・リスク	731,276	731,276	58,502	58,502
20	うち、基礎的手法適用分	428	428	34	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	730,847	58,467	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	157,244	132,290	13,334	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)*	19,683,990	20,004,551	1,574,719	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。