

リスク・アセットの概要(2019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	
		2018年9月末	2018年6月末	2018年9月末	2018年6月末
1	信用リスク	13,066,031	13,243,506	1,104,268	1,118,645
2	うち、標準的手法適用分	273,051	434,200	21,844	34,736
3	うち、内部格付手法適用分	12,288,694	12,326,091	1,042,081	1,045,252
	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	15,519	1,427	1,241	114
	その他	488,766	481,788	39,101	38,543
4	カウンターパーティ信用リスク	725,532	676,779	59,243	55,243
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	232,794	214,642	19,728	18,187
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	375,779	354,509	30,062	28,360
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	34,835	30,447	2,786	2,435
	その他	82,124	77,178	6,665	6,259
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	362,658	385,118	30,753	32,658
	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	2,283,880	2,342,822	193,673	198,671
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	153,263	152,197	12,996	12,906
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	43,509	41,711	3,689	3,537
14	うち、内部格付手法における指定関数方式適用分	61,565	60,680	5,220	5,145
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	48,188	49,805	4,086	4,223
16	マーケット・リスク	1,125,470	1,241,486	90,037	99,318
17	うち、標準的方式適用分	19,683	166,600	1,574	13,328
18	うち、内部モデル方式適用分	1,105,786	1,074,886	88,462	85,990
19	オペレーショナル・リスク	963,589	989,074	77,087	79,125
20	うち、基礎的手法適用分	164,962	163,890	13,197	13,111
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	798,627	825,183	63,890	66,014
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	245,820	243,345	20,845	20,635
	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 (スケーリングファクター適用後)*	19,861,313	20,215,073	1,588,905	1,617,205

* 項番25のリスク・アセットのみスケーリングファクターを適用した値を記載しております。