

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】

(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	13,207,661	13,319,094	1,109,572	1,119,129
2	うち、標準的手法適用分	741	1,417	59	113
3	うち、内部格付手法適用分	11,033,199	11,167,156	935,615	946,974
	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	2,173,720	2,150,520	173,897	172,041
4	カウンターパーティ信用リスク	660,517	614,075	54,041	50,226
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	230,153	211,545	19,517	17,939
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	375,711	354,368	30,056	28,349
	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	19,816	17,713	1,680	1,502
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	305,087	311,285	25,871	26,396
	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	125,404	122,405	10,634	10,379
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	37,755	35,122	3,201	2,978
14	うち、内部格付手法における指定関数方式適用分	40,946	39,081	3,472	3,314
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	46,702	48,201	3,960	4,087
16	マーケット・リスク	1,109,536	1,225,975	88,762	98,078
17	うち、標準的方式適用分	3,750	151,089	300	12,087
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	727,622	731,276	58,209	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	727,194	730,847	58,175	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	157,262	157,244	13,335	13,334
	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)*	19,426,260	19,683,990	1,554,100	1,574,719

\* 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。