

リスク・アセットの概要(2019年3月期第3四半期)

【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12月末	2018年9月末	2018年12月末	2018年9月末
1	信用リスク	12,933,672	13,066,031	1,093,015	1,104,268
2	うち、標準的手法適用分	304,588	273,051	24,367	21,844
3	うち、内部格付手法適用分	12,150,384	12,288,694	1,030,352	1,042,081
	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	15,453	15,519	1,236	1,241
	その他	463,245	488,766	37,059	39,101
4	カウンターパーティ信用リスク	787,679	725,532	64,300	59,243
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	251,610	232,794	21,321	19,728
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	409,681	375,779	32,774	30,062
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	41,792	34,835	3,343	2,786
	その他	84,594	82,124	6,860	6,665
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	190,556	362,658	16,159	30,753
	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	1,611,159	2,283,880	136,626	193,673
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	165,581	153,263	14,041	12,996
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	44,741	43,509	3,794	3,689
14	うち、内部格付手法における指定関数方式適用分	74,769	61,565	6,340	5,220
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	46,070	48,188	3,906	4,086
16	マーケット・リスク	1,326,080	1,125,470	106,086	90,037
17	うち、標準的方式適用分	21,291	19,683	1,703	1,574
18	うち、内部モデル方式適用分	1,304,788	1,105,786	104,383	88,462
19	オペレーショナル・リスク	963,589	963,589	77,087	77,087
20	うち、基礎的手法適用分	164,962	164,962	13,197	13,197
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	798,627	63,890	63,890
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	254,914	245,820	21,616	20,845
	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)*	19,111,660	19,861,313	1,528,932	1,588,905

\* 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。