

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】

(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	12,981,792	13,207,661	1,090,794	1,109,572
2	うち、標準的手法適用分	1,117	741	89	59
3	うち、内部格付手法適用分	10,885,666	11,033,199	923,104	935,615
	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	2,095,008	2,173,720	167,600	173,897
4	カウンターパーティ信用リスク	719,154	660,517	58,817	54,041
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	248,360	230,153	21,060	19,517
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	409,617	375,711	32,769	30,056
	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	19,383	19,816	1,643	1,680
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	155,266	305,087	13,166	25,871
	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	127,724	125,404	10,831	10,634
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	39,076	37,755	3,313	3,201
14	うち、内部格付手法における指定関数方式適用分	42,577	40,946	3,610	3,472
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	46,702	3,906	3,960
16	マーケット・リスク	1,308,422	1,109,536	104,673	88,762
17	うち、標準的方式適用分	3,634	3,750	290	300
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	727,622	727,622	58,209	58,209
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	727,194	58,175	58,175
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	157,357	157,262	13,343	13,335
	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)*	18,580,794	19,426,260	1,486,463	1,554,100

* 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。