

リスク・アセットの概要(2019年3月期)  
【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	
		2019年3月末	2018年12月末	2019年3月末	2018年12月末
1	信用リスク	13,469,635	12,981,792	1,130,635	1,090,794
2	うち、標準的手法適用分	2,912	1,117	232	89
3	うち、内部格付手法適用分	11,055,054	10,885,666	937,468	923,104
	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	2,411,669	2,095,008	192,933	167,600
4	カウンターパーティ信用リスク	834,658	719,154	68,198	58,817
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	277,387	248,360	23,522	21,060
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	495,998	409,617	39,679	32,769
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	41,617	41,792	3,329	3,343
	その他	19,655	19,383	1,666	1,643
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	159,785	155,266	13,549	13,166
8	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算(ルック・スルー方式)	1,153,184		92,254	
9	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算(マンドート方式)	663,188		53,055	
	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算(蓋然性方式250%)	-		-	
	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算(蓋然性方式400%)	-		-	
10	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算(フォールバック方式1,250%)	1,422		113	
	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		136,626
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	256,556	127,724	20,524	10,831
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	239,805		19,184	
14	うち、外部格付準拠方式適用分	14,696		1,175	
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	-		-	
	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		3,313
	うち、内部格付手法における指定関数方式適用分		42,577		3,610
	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	2,053	46,070	164	3,906
16	マーケット・リスク	1,086,328	1,308,422	86,906	104,673
17	うち、標準的方式適用分	4,528	3,634	362	290
18	うち、内部モデル方式適用分	1,081,800	1,304,788	86,544	104,383
19	オペレーショナル・リスク	670,113	727,622	53,609	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	669,684	727,194	53,574	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	157,313	157,357	13,340	13,343
	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)*	19,152,340	18,580,794	1,532,187	1,486,463

\* 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。