

リスク・アセットの概要(2020年3月期第1四半期)
【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	
		2019年6月末	2019年3月末	2019年6月末	2019年3月末
1	信用リスク	12,653,470	13,195,265	1,069,004	1,115,178
2	うち、標準的手法適用分	336,019	293,105	26,881	23,448
3	うち、内部格付手法適用分	11,818,057	12,407,702	1,002,171	1,052,173
	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	29,832	30,191	2,386	2,415
	その他	469,560	464,265	37,564	37,141
4	カウンターパーティ信用リスク	1,040,908	905,383	84,849	73,857
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	312,693	280,827	26,500	23,798
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	596,188	496,078	47,695	39,686
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	48,931	41,617	3,914	3,329
	その他	83,095	86,860	6,739	7,043
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	236,769	175,521	20,078	14,884
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)	1,111,600	1,153,184	88,928	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)	714,216	712,155	57,137	56,972
	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%)	1,250	1,422	100	113
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	342,513	322,082	27,401	25,766
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	327,073	304,053	26,165	24,324
14	うち、外部格付準拠方式適用分	14,254	14,696	1,140	1,175
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	-	-	-	-
	うち、1,250%のリスク・ウェイト適用分	1,186	3,332	94	266
16	マーケット・リスク	1,075,359	1,104,072	86,028	88,325
17	うち、標準的方式適用分	20,181	22,272	1,614	1,781
18	うち、内部モデル方式適用分	1,055,177	1,081,800	84,414	86,544
19	オペレーショナル・リスク	899,035	899,035	71,922	71,922
20	うち、基礎的手法適用分	173,667	173,667	13,893	13,893
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	725,368	725,368	58,029	58,029
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	275,193	272,523	23,336	23,109
	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)*	19,109,831	19,529,822	1,528,786	1,562,385

* 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。