

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】  
(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	12,797,294	13,469,635	1,074,716	1,130,635
2	うち、標準的手法適用分	1,364	2,912	109	232
3	うち、内部格付手法適用分	10,611,123	11,055,054	899,823	937,468
	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	2,184,806	2,411,669	174,784	192,933
4	カウンターパーティ信用リスク	932,248	834,658	76,156	68,198
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	309,249	277,387	26,224	23,522
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	554,904	495,998	44,392	39,679
	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	19,162	19,655	1,624	1,666
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	221,274	159,785	18,764	13,549
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)	665,671	663,188	53,253	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%)	1,250	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	256,478	256,556	20,518	20,524
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	242,224	239,805	19,377	19,184
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	0	2,053	0	164
16	マーケット・リスク	1,058,618	1,086,328	84,689	86,906
17	うち、標準的方式適用分	3,440	4,528	275	362
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	670,113	670,113	53,609	53,609
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	669,684	53,574	53,574
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	157,311	157,313	13,340	13,340
	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)*	18,550,949	19,152,340	1,484,075	1,532,187

\* 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。