

リスク・アセットの概要(2020年3月期第2四半期)
 [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9月末	2019年6月末	2019年9月末	2019年6月末
1	信用リスク	12,152,104	12,653,470	1,026,822	1,069,004
2	うち、標準的手法適用分	297,989	336,019	23,839	26,881
3	うち、内部格付手法適用分	11,386,340	11,818,057	965,561	1,002,171
	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	30,359	29,832	2,428	2,386
	その他	437,414	469,560	34,993	37,564
4	カウンターパーティ信用リスク	1,114,942	1,040,908	90,887	84,849
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	334,952	312,693	28,389	26,500
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	643,868	596,188	51,509	47,695
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	47,669	48,931	3,813	3,914
	その他	88,452	83,095	7,175	6,739
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	240,052	236,769	20,356	20,078
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)	1,235,895	1,111,600	98,871	88,928
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)	753,025	714,216	60,242	57,137
	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%)	1,238	1,250	99	100
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	345,127	342,513	27,610	27,401
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	331,655	327,073	26,532	26,165
14	うち、外部格付準拠方式適用分	12,391	14,254	991	1,140
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	1,080	1,186	86	94
16	マーケット・リスク	981,661	1,075,359	78,532	86,028
17	うち、標準的方式適用分	11,776	20,181	942	1,614
18	うち、内部モデル方式適用分	969,885	1,055,177	77,590	84,414
19	オペレーショナル・リスク	864,666	899,035	69,173	71,922
20	うち、基礎的手法適用分	169,798	173,667	13,583	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	694,868	725,368	55,589	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	245,007	275,193	20,776	23,336
	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) [*]	18,667,159	19,109,831	1,493,372	1,528,786

* 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。