

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]
 (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	12,241,476	12,797,294	1,027,977	1,074,716
2	うち、標準的手法適用分	1,317	1,364	105	109
3	うち、内部格付手法適用分	10,137,290	10,611,123	859,642	899,823
	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	2,102,867	2,184,806	168,229	174,784
4	カウンターパーティ信用リスク	1,013,900	932,248	82,803	76,156
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	331,708	309,249	28,128	26,224
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	613,817	554,904	49,105	44,392
	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	20,705	19,162	1,755	1,624
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	214,223	221,274	18,166	18,764
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)	752,084	665,671	60,166	53,253
	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	257,704	256,478	20,616	20,518
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	245,313	242,224	19,625	19,377
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	0	0	0	0
16	マーケット・リスク	972,472	1,058,618	77,797	84,689
17	うち、標準的方式適用分	2,587	3,440	207	275
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	651,932	670,113	52,154	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	651,503	669,684	52,120	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	157,345	157,311	13,342	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) [*]	18,149,949	18,550,949	1,451,995	1,484,075

* 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。