

リスク・アセットの概要(2020年3月期第3四半期)
 【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12月末	2019年9月末	2019年12月末	2019年9月末
1	信用リスク	12,312,679	12,152,104	1,040,163	1,026,822
2	うち、標準的手法適用分	338,269	297,989	27,061	23,839
3	うち、内部格付手法適用分	11,489,328	11,386,340	974,295	965,561
	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	24,887	30,359	1,990	2,428
	その他	460,194	437,414	36,815	34,993
4	カウンターパーティ信用リスク	1,075,353	1,114,942	87,697	90,887
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	327,486	334,952	27,757	28,389
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	611,357	643,868	48,908	51,509
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	41,936	47,669	3,354	3,813
	その他	94,572	88,452	7,676	7,175
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	229,303	240,052	19,444	20,356
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)	1,465,893	1,235,895	117,271	98,871
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)	791,307	753,025	63,304	60,242
	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%)	1,146	1,238	91	99
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	340,905	345,127	27,272	27,610
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	327,646	331,655	26,211	26,532
14	うち、外部格付準拠方式適用分	12,269	12,391	981	991
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	989	1,080	79	86
16	マーケット・リスク	1,297,275	981,661	103,782	78,532
17	うち、標準的方式適用分	12,053	11,776	964	942
18	うち、内部モデル方式適用分	1,285,221	969,885	102,817	77,590
19	オペレーショナル・リスク	864,666	864,666	69,173	69,173
20	うち、基礎的手法適用分	169,798	169,798	13,583	13,583
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	694,868	55,589	55,589
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	246,479	245,007	20,901	20,776
	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)	19,363,782	18,667,159	1,549,102	1,493,372

* 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。