

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]  
 (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	12,359,204	12,241,476	1,037,923	1,027,977
2	うち、標準的手法適用分	1,061	1,317	84	105
3	うち、内部格付手法適用分	10,247,361	10,137,290	868,976	859,642
	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	2,110,781	2,102,867	168,862	168,229
4	カウンターパーティ信用リスク	1,000,803	1,013,900	81,732	82,803
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	324,555	331,708	27,522	28,128
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	611,247	613,817	48,899	49,105
	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	23,063	20,705	1,955	1,755
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	195,887	214,223	16,611	18,166
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)	790,423	752,084	63,233	60,166
	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	257,936	257,704	20,634	20,616
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	245,667	245,313	19,653	19,625
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	0	0	0	0
16	マーケット・リスク	1,288,015	972,472	103,041	77,797
17	うち、標準的方式適用分	2,793	2,587	223	207
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	651,932	651,932	52,154	52,154
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	651,503	52,120	52,120
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	157,509	157,345	13,356	13,342
	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)	18,825,656	18,149,949	1,506,052	1,451,995

\* 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。