

リスク・アセットの概要(2020年3月期)

【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	
		2020年3月末	2019年12月末	2020年3月末	2019年12月末
1	信用リスク	12,085,492	12,312,679	1,021,035	1,040,163
2	うち、標準的手法適用分	280,125	338,269	22,410	27,061
3	うち、内部格付手法適用分	11,290,809	11,489,328	957,460	974,295
	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	59,850	24,887	4,788	1,990
	その他	454,706	460,194	36,376	36,815
4	カウンターパーティ信用リスク	1,201,970	1,075,353	98,122	87,697
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	392,916	327,486	33,304	27,757
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	663,072	611,357	53,045	48,908
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	49,867	41,936	3,989	3,354
	その他	96,113	94,572	7,782	7,676
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	221,775	229,303	18,806	19,444
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)	861,670	1,465,893	68,933	117,271
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)	763,076	791,307	61,046	63,304
	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%)	1,137	1,146	91	91
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	348,026	340,905	27,842	27,272
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	334,315	327,646	26,745	26,211
14	うち、外部格付準拠方式適用分	12,804	12,269	1,024	981
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	906	989	72	79
16	マーケット・リスク	1,325,398	1,297,275	106,031	103,782
17	うち、標準的方式適用分	13,585	12,053	1,086	964
18	うち、内部モデル方式適用分	1,311,813	1,285,221	104,945	102,817
19	オペレーショナル・リスク	860,710	864,666	68,856	69,173
20	うち、基礎的手法適用分	166,809	169,798	13,344	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	693,900	694,868	55,512	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	257,586	246,479	21,843	20,901
	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)*	18,657,616	19,363,782	1,492,609	1,549,102

* 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。