

リスク・アセットの概要(2020年3月期)  
【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	
		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	12,128,127	12,359,204	1,017,944	1,037,923
2	うち、標準的手法適用分	798	1,061	63	84
3	うち、内部格付手法適用分	9,936,345	10,247,361	842,602	868,976
	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	2,190,983	2,110,781	175,278	168,862
4	カウンターパーティ信用リスク	1,122,066	1,000,803	91,729	81,732
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	389,713	324,555	33,047	27,522
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	663,005	611,247	53,040	48,899
	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	19,479	23,063	1,651	1,955
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	198,330	195,887	16,818	16,611
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)	762,411	790,423	60,992	63,233
	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	275,322	257,936	22,025	20,634
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	262,517	245,667	21,001	19,653
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	0	0	0	0
16	マーケット・リスク	1,316,579	1,288,015	105,326	103,041
17	うち、標準的方式適用分	4,765	2,793	381	223
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	647,978	651,932	51,838	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	647,549	651,503	51,803	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	157,454	157,509	13,352	13,356
	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)*	18,113,159	18,825,656	1,449,052	1,506,052

\* 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。