

リスク・アセットの概要(2021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	
		2020年12月末	2020年9月末	2020年12月末	2020年9月末
1	信用リスク	12,234,503	12,116,740	1,033,587	1,023,301
2	うち、標準的手法適用分	302,406	348,974	24,192	27,917
3	うち、内部格付手法適用分	11,422,274	11,242,063	968,608	953,327
	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残残存価額のエクスポージャー	74,935	62,402	5,994	4,992
	その他	434,887	463,299	34,791	37,063
4	カウンターパーティ信用リスク	1,255,281	1,213,814	102,507	99,088
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	408,698	389,420	34,645	33,012
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	699,392	666,708	55,951	53,336
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	42,452	52,555	3,396	4,204
	その他	104,737	105,129	8,514	8,534
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	310,806	249,395	26,356	21,148
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)	1,306,908	1,347,216	104,552	107,777
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)	891,841	842,419	71,347	67,393
	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%)	1,020	1,103	81	88
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	288,373	313,985	23,069	25,118
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	265,924	295,189	21,273	23,615
14	うち、外部格付準拠方式適用分	21,787	18,056	1,743	1,444
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	661	739	52	59
16	マーケット・リスク	1,592,865	1,321,748	127,429	105,739
17	うち、標準的方式適用分	12,353	12,277	988	982
18	うち、内部モデル方式適用分	1,580,512	1,309,470	126,440	104,757
19	オペレーショナル・リスク	878,468	878,468	70,277	70,277
20	うち、基礎的手法適用分	157,690	157,690	12,615	12,615
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	720,778	720,778	57,662	57,662
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	273,535	265,933	23,195	22,551
	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)*	19,780,068	19,281,057	1,582,405	1,542,484

\* 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。