

リスク・アセットの概要(2019年3月期第1四半期)

【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	
		2018年6月末	2018年3月末	2018年6月末	2018年3月末
1	信用リスク	13,243,506	13,491,575	1,118,645	1,140,187
2	うち、標準的手法適用分	434,200	372,692	34,736	29,815
3	うち、内部格付手法適用分	12,326,091	12,679,389	1,045,252	1,075,212
	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	1,427	1,408	114	112
	その他	481,788	438,086	38,543	35,046
4	カウンターパーティ信用リスク	676,779	725,303	55,243	59,202
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	214,642	230,244	18,187	19,516
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	354,509	389,775	28,360	31,182
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	30,447	26,351	2,435	2,108
	その他	77,178	78,932	6,259	6,396
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	385,118	300,171	32,658	25,454
	複数の資産及び取引を裏付けとするエクスポージャー	-	-	-	-
	信用リスク・アセットのみなし計算が適用されるエクスポージャー	2,342,822	2,417,814	198,671	205,030
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	152,197	159,362	12,906	13,513
13	うち、内部格付手法における外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分	41,711	37,134	3,537	3,148
14	うち、内部格付手法における指定関数方式適用分	60,680	71,623	5,145	6,073
15	うち、標準的手法適用分	-	-	-	-
	うち、1,250%のリスク・ウェイト適用分	49,805	50,604	4,223	4,291
16	マーケット・リスク	1,241,486	1,163,880	99,318	93,110
17	うち、標準的方式適用分	166,600	170,246	13,328	13,619
18	うち、内部モデル方式適用分	1,074,886	993,634	85,990	79,490
19	オペレーショナル・リスク	989,074	989,074	79,125	79,125
20	うち、基礎的手法適用分	163,890	163,890	13,111	13,111
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	825,183	825,183	66,014	66,014
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	243,345	218,908	20,635	18,563
	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)*	20,215,073	20,427,360	1,617,205	1,634,188

\* 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。