

リスク・アセットの概要(2019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	
		2019年3月末	2018年12月末	2019年3月末	2018年12月末
1	信用リスク	13,195,265	12,933,672	1,115,178	1,093,015
2	うち、標準的手法適用分	293,105	304,588	23,448	24,367
3	うち、内部格付手法適用分	12,407,702	12,150,384	1,052,173	1,030,352
	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	30,191	15,453	2,415	1,236
	その他	464,265	463,245	37,141	37,059
4	カウンターパーティ信用リスク	905,383	787,679	73,857	64,300
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	280,827	251,610	23,798	21,321
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	496,078	409,681	39,686	32,774
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	41,617	41,792	3,329	3,343
	その他	86,860	84,594	7,043	6,860
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	175,521	190,556	14,884	16,159
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)	1,153,184		92,254	
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)	712,155		56,972	
	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%)	1,422		113	
	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		1,611,159		136,626
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	322,082	165,581	25,766	14,041
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	304,053		24,324	
14	うち、外部格付準拠方式適用分	14,696		1,175	
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	-		-	
	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		44,741		3,794
	うち、内部格付手法における指定関数方式適用分		74,769		6,340
	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	3,332	46,070	266	3,906
16	マーケット・リスク	1,104,072	1,326,080	88,325	106,086
17	うち、標準的方式適用分	22,272	21,291	1,781	1,703
18	うち、内部モデル方式適用分	1,081,800	1,304,788	86,544	104,383
19	オペレーショナル・リスク	899,035	963,589	71,922	77,087
20	うち、基礎的手法適用分	173,667	164,962	13,893	13,197
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	725,368	798,627	58,029	63,890
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	272,523	254,914	23,109	21,616
	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)*	19,529,822	19,111,660	1,562,385	1,528,932

* 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。