

リスク・アセットの概要(2021年3月期第1四半期)
【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6月末	2020年3月末	2020年6月末	2020年3月末
1	信用リスク	12,293,257	12,128,127	1,032,648	1,017,944
2	うち、標準的手法適用分	1,423	798	113	63
3	うち、内部格付手法適用分	10,247,378	9,936,345	868,977	842,602
	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	2,044,455	2,190,983	163,556	175,278
4	カウンターパーティ信用リスク	1,106,565	1,122,066	90,444	91,729
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	376,837	389,713	31,955	33,047
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	649,169	663,005	51,933	53,040
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	57,611	49,867	4,608	3,989
	その他	22,947	19,479	1,945	1,651
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	339,710	198,330	28,807	16,818
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)	994,986	861,670	79,598	68,933
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)	804,574	762,411	64,365	60,992
	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%)	1,135	1,137	90	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	244,823	275,322	19,585	22,025
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	232,176	262,517	18,574	21,001
14	うち、外部格付準拠方式適用分	12,646	12,804	1,011	1,024
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	1,279,693	1,316,579	102,375	105,326
17	うち、標準的方式適用分	3,978	4,765	318	381
18	うち、内部モデル方式適用分	1,275,714	1,311,813	102,057	104,945
19	オペレーショナル・リスク	647,978	647,978	51,838	51,838
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	647,549	51,803	51,803
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	157,457	157,454	13,352	13,352
	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)*	18,538,841	18,113,159	1,483,107	1,449,052

* 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。