

リスク・アセットの概要(2021年3月期第2四半期)

【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9月末	2020年6月末	2020年9月末	2020年6月末
1	信用リスク	12,080,899	12,293,257	1,015,139	1,032,648
2	うち、標準的手法適用分	1,077	1,423	86	113
3	うち、内部格付手法適用分	10,138,987	10,247,378	859,786	868,977
	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	1,940,834	2,044,455	155,266	163,556
4	カウンターパーティ信用リスク	1,130,923	1,106,565	92,456	90,444
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	387,115	376,837	32,827	31,955
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	665,382	649,169	53,230	51,933
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	52,555	57,611	4,204	4,608
	その他	25,870	22,947	2,193	1,945
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	233,895	339,710	19,834	28,807
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)	1,347,216	994,986	107,777	79,598
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)	841,700	804,574	67,336	64,365
	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%)	1,103	1,135	88	90
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	232,170	244,823	18,573	19,585
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	214,114	232,176	17,129	18,574
14	うち、外部格付準拠方式適用分	18,056	12,646	1,444	1,011
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	1,313,098	1,279,693	105,047	102,375
17	うち、標準的方式適用分	3,628	3,978	290	318
18	うち、内部モデル方式適用分	1,309,470	1,275,714	104,757	102,057
19	オペレーショナル・リスク	658,753	647,978	52,700	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	658,324	647,549	52,665	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	157,547	157,457	13,360	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)*	18,653,915	18,538,841	1,492,313	1,483,107

\* 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。