

リスク・アセットの概要(2021年3月期)

【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	
		2021年3月末	2020年12月末	2021年3月末	2020年12月末
1	信用リスク	12,381,768	12,266,219	1,040,123	1,030,810
2	うち、標準的手法適用分	1,106	1,260	88	100
3	うち、内部格付手法適用分	10,329,612	10,315,117	875,951	874,721
	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	2,051,049	1,949,841	164,083	155,987
4	カウンターパーティ信用リスク	1,155,749	1,174,953	94,542	96,080
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	405,097	406,010	34,352	34,429
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	674,527	698,198	53,962	55,855
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	47,434	42,452	3,794	3,396
	その他	28,689	28,292	2,432	2,399
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	482,003	295,115	40,873	25,025
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)	1,054,083	1,306,908	84,326	104,552
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)	948,627	891,056	75,890	71,284
	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%)	1,091	1,020	87	81
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	235,194	209,605	18,815	16,768
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	218,062	187,817	17,444	15,025
14	うち、外部格付準拠方式適用分	17,132	21,787	1,370	1,743
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	1,407,899	1,583,581	112,631	126,686
17	うち、標準的方式適用分	2,640	3,068	211	245
18	うち、内部モデル方式適用分	1,405,258	1,580,512	112,420	126,440
19	オペレーショナル・リスク	657,321	658,753	52,585	52,700
20	うち、基礎的手法適用分	-	428	-	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	657,321	658,324	52,585	52,665
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	157,826	157,529	13,383	13,358
	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)*	19,165,759	19,216,866	1,533,260	1,537,349

* 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。