

リスク・アセットの概要(2023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	
		2022年9月末	2022年6月末	2022年9月末	2022年6月末
1	信用リスク	12,823,173	12,324,872	1,076,829	1,035,243
2	うち、標準的手法適用分	922	1,077	73	86
3	うち、内部格付手法適用分	10,620,008	10,261,275	900,576	870,156
	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	2,202,241	2,062,520	176,179	165,001
4	カウンターパーティ信用リスク	1,157,022	1,161,137	94,645	95,013
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	416,803	415,944	35,344	35,272
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	643,194	651,078	51,455	52,086
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	79,751	67,871	6,380	5,429
	その他	17,273	26,242	1,464	2,225
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	348,378	394,966	29,542	33,493
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)	1,273,213	759,247	101,857	60,739
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)	2,036,840	1,400,444	162,947	112,035
	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%)	1,762	1,683	140	134
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	347,861	315,937	27,828	25,274
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	331,957	299,407	26,556	23,952
14	うち、外部格付準拠方式適用分	15,904	16,529	1,272	1,322
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	1,270,454	1,355,051	101,636	108,404
17	うち、標準的方式適用分	13,894	6,575	1,111	526
18	うち、内部モデル方式適用分	1,256,559	1,348,475	100,524	107,878
19	オペレーショナル・リスク	628,846	631,520	50,307	50,521
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
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	628,846	631,520	50,307	50,521
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	271,143	265,348	22,992	22,501
	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)*	20,859,113	19,292,037	1,668,729	1,543,363

\* 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。