

リスク・アセットの概要(2024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<br>該当番号   |  | イ          | ロ         | ハ         | ニ         |
|                 |  | リスク・アセット   |           | 所要自己資本    |           |
|                 |  | 2024年3月末   | 2023年12月末 | 2024年3月末  | 2023年12月末 |
| 1               | 信用リスク  | 15,760,902 |           | 1,260,872 |           |
| 2               | うち、標準的手法適用分                                      | 512,447    |           | 40,995    |           |
| 3               | うち、基礎的内部格付手法適用分                                  | 10,858,672 |           | 868,693   |           |
| 4               | うち、スロッシング・クライテリア適用分                              | 799,142    |           | 63,931    |           |
| 5               | うち、先進的内部格付手法適用分                                  | 2,512,404  |           | 200,992   |           |
|                 | 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                      | 295,966    |           | 23,677    |           |
|                 | その他  | 782,267    |           | 62,581    |           |
| 6               | カウンターパーティ信用リスク                                   | 456,883    |           | 36,550    |           |
| 7               | うち、SA-CCR適用分                                     | 417,414    |           | 33,393    |           |
| 8               | うち、期待エクスポージャー方式適用分                               | —          |           | —         |           |
|                 | うち、中央清算機関関連エクスポージャー                              | 7,986      |           | 638       |           |
| 9               | その他  | 31,482     |           | 2,518     |           |
| 10              | CVAリスク   | 512,063    |           | 40,965    |           |
|                 | うち、SA-CVA適用分                                     | —          |           | —         |           |
|                 | うち、完全なBA-CVA適用分                                  | 512,063    |           | 40,965    |           |
|                 | うち、限定的なBA-CVA適用分                                 | —          |           | —         |           |
| 11              | 経過措置により適用されるマーケット・ベース方式に基づく株式等エクスポージャー           | 423,203    |           | 33,856    |           |
| 12              | 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(レック・スルー方式)      | 1,634,100  |           | 130,728   |           |
| 13              | 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)        | 1,474,817  |           | 117,985   |           |
|                 | 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%)      | —          |           | —         |           |
| 14              | 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1250%) | 746        |           | 59        |           |
| 15              | 未決済取引  | —          |           | —         |           |
| 16              | 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               | 438,462    |           | 35,076    |           |
| 17              | うち、内部格付手法準拠方式適用分                                 | 411,818    |           | 32,945    |           |
| 18              | うち、外部格付準拠方式適用分又は内部評価方式適用分                        | 26,613     |           | 2,129     |           |
| 19              | うち、標準的手法準拠方式適用分                                  | —          |           | —         |           |
|                 | うち、1250%のリスク・ウェイト適用分                             | 30         |           | 2         |           |
| 20              | マーケット・リスク  | 990,531    |           | 79,242    |           |
| 21              | うち、標準的方式適用分                                      | 990,531    |           | 79,242    |           |
| 22              | うち、内部モデル方式適用分                                    | —          |           | —         |           |
|                 | うち、簡易的方式適用分                                      | —          |           | —         |           |
| 23              | 勘定間の振替分  | —          |           | —         |           |
| 24              | オペレーショナル・リスク                                     | 1,060,031  |           | 84,802    |           |
| 25              | 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                 | 322,631    |           | 25,810    |           |
| 26              | フロア調整  | —          |           | —         |           |
| 27              | 合計   | 23,074,373 |           | 1,845,949 |           |

(単位:百万円)

## OV1:リスク・アセットの概要

| 国際様式の<br>該当番号 |   | イ        | ロ          | ハ        | ニ         |
|---------------|---|----------|------------|----------|-----------|
|               |   | リスク・アセット |            | 所要自己資本   |           |
|               |   | 2024年3月末 | 2023年12月末  | 2024年3月末 | 2023年12月末 |
| 1             | 信用リスク   |          | 14,350,035 |          | 1,209,551 |
| 2             | うち、標準的手法適用分                                       |          | 563,707    |          | 45,096    |
| 3             | うち、内部格付手法適用分                                      |          | 12,822,540 |          | 1,087,351 |
|               | 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                       |          | 279,884    |          | 22,390    |
|               | その他   |          | 683,903    |          | 54,712    |
| 4             | カウンターパーティ信用リスク                                    |          | 1,201,646  |          | 97,996    |
| 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                             |          | 379,328    |          | 32,152    |
| 6             | うち、期待エクスポージャー方式適用分                                |          | -          |          | -         |
|               | うち、CVAリスク   |          | 605,663    |          | 48,453    |
|               | うち、中央清算機関関連エクスポージャー                               |          | 71,014     |          | 5,681     |
|               | その他   |          | 145,639    |          | 11,710    |
| 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                        |          | 311,530    |          | 26,417    |
| 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(リスク・スルー方式)       |          | 1,669,835  |          | 133,586   |
| 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)         |          | 1,757,574  |          | 140,605   |
|               | 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%) |          | 800        |          | 64        |
| 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                |          | 404,439    |          | 32,355    |
| 13            | うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分                          |          | 383,178    |          | 30,654    |
| 14            | うち、外部格付準拠方式適用分                                    |          | 21,214     |          | 1,697     |
| 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                             |          | 46         |          | 3         |
| 16            | マーケット・リスク   |          | 1,713,471  |          | 137,077   |
| 17            | うち、標準的方式適用分                                       |          | 65,110     |          | 5,208     |
| 18            | うち、内部モデル方式適用分                                     |          | 1,648,361  |          | 131,868   |
| 19            | オペレーショナル・リスク                                      |          | 881,082    |          | 70,486    |
| 20            | うち、基礎的手法適用分                                       |          | 142,736    |          | 11,418    |
| 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                                     |          | 738,346    |          | 59,067    |
| 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                  |          | 310,740    |          | 26,350    |
|               | 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)*                             |          | 23,431,159 |          | 1,874,492 |

\* 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。