

リスク・アセットの概要(2025年3月期第3四半期)
【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 該当番号		イ	ロ	ハ	ニ
		リスク・アセット		所要自己資本	
		2024年12月末	2024年9月末	2024年12月末	2024年9月末
1	信用リスク	14,940,387	14,700,025	1,195,230	1,176,002
2	うち、標準的手法適用分	539,857	541,451	43,188	43,316
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	10,292,368	10,154,111	823,389	812,328
4	うち、スロットティング・クライテリア適用分	805,398	765,370	64,431	61,229
5	うち、先進的内部格付手法適用分	2,428,847	2,341,209	194,307	187,296
	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	332,568	355,193	26,605	28,415
	その他	541,346	542,688	43,307	43,415
6	カウンターパーティ信用リスク	444,509	406,290	35,560	32,503
7	うち、SA-CCR適用分	390,570	352,430	31,245	28,194
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	23,602	21,985	1,888	1,758
9	その他	30,336	31,874	2,426	2,549
10	CVAリスク	484,614	465,680	38,769	37,254
	うち、SA-CVA適用分	—	—	—	—
	うち、完全なBA-CVA適用分	484,614	465,680	38,769	37,254
	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	511,649	453,333	40,931	36,266
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(ルック・スルー方式)	1,741,275	1,620,968	139,302	129,677
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(マンデート方式)	1,643,465	1,487,051	131,477	118,964
	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%)	453	424	36	33
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	431,033	458,053	34,482	36,644
17	うち、内部格付手法準拠方式適用分	400,157	432,277	32,012	34,582
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	30,867	25,762	2,469	2,060
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	8	13	0	1
20	マーケット・リスク	1,008,692	1,023,431	80,695	81,874
21	うち、標準的方式適用分	1,008,692	1,023,431	80,695	81,874
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	1,237,876	1,237,876	99,030	99,030
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	355,655	342,745	28,452	27,419
26	フロア調整	—	—	—	—
27	合計	22,799,612	22,195,880	1,823,968	1,775,670