

リスク・アセットの概要(2025年6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 該当番号		イ	ロ	ハ	ニ
		リスク・アセット		所要自己資本	
		2025年6月末	2025年3月末	2025年6月末	2025年3月末
1	信用リスク	14,076,644	14,490,417	1,126,131	1,159,233
2	うち、標準的手法適用分	1,597,081	1,581,342	127,766	126,507
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	8,718,195	9,104,899	697,455	728,391
4	うち、スロッシング・クライテリア適用分	549,998	658,378	43,999	52,670
5	うち、先進的内部格付手法適用分	2,428,048	2,416,896	194,243	193,351
	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	219,012	210,780	17,521	16,862
	その他	564,307	518,119	45,144	41,449
6	カウンターパーティ信用リスク	358,185	393,146	28,654	31,451
7	うち、SA-CCR適用分	305,831	331,767	24,466	26,541
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	26,815	24,914	2,145	1,993
9	その他	25,539	36,464	2,043	2,917
10	CVAリスク	316,692	412,168	25,335	32,973
	うち、SA-CVA適用分	—	—	—	—
	うち、完全なBA-CVA適用分	316,692	412,168	25,335	32,973
	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	641,915	621,166	51,353	49,693
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)	1,698,933	1,641,400	135,914	131,312
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(マंडート方式)	1,588,662	1,611,645	127,092	128,931
	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%)	320	348	25	27
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	453,815	370,963	36,305	29,677
17	うち、内部格付手法準拠方式適用分	428,662	341,463	34,293	27,317
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	25,146	29,494	2,011	2,359
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	6	5	0	0
20	マーケット・リスク	1,196,765	1,221,742	95,741	97,739
21	うち、標準的方式適用分	1,196,765	1,221,742	95,741	97,739
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	1,284,217	1,284,217	102,737	102,737
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	366,287	420,135	29,303	33,610
26	フロア調整	—	—	—	—
27	合計	21,982,439	22,467,352	1,758,595	1,797,388