

リスク・アセットの概要 (2026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<br>該当番号   |  | イ          | ロ          | ハ         | ニ         |
|                 |  | リスク・アセット   |            | 所要自己資本    |           |
|                 |  | 2026年3月末   | 2025年12月末  | 2026年3月末  | 2025年12月末 |
| 1               | 信用リスク  | 15,533,490 | 15,207,192 | 1,242,679 | 1,216,575 |
| 2               | うち、標準的手法適用分                                      | 1,400,846  | 1,183,342  | 112,067   | 94,667    |
| 3               | うち、基礎的内部格付手法適用分                                  | 8,537,074  | 8,431,614  | 682,965   | 674,529   |
| 4               | うち、スロッシング・クライテリア適用分                              | 562,666    | 620,718    | 45,013    | 49,657    |
| 5               | うち、先進的内部格付手法適用分                                  | 2,736,057  | 2,663,326  | 218,884   | 213,066   |
|                 | 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  | 2,296,844  | 2,308,190  | 183,747   | 184,655   |
| 6               | カウンターパーティ信用リスク                                   | 456,316    | 483,705    | 36,505    | 38,696    |
| 7               | うち、SA-CCR適用分                                     | 386,479    | 416,248    | 30,918    | 33,299    |
| 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                              | 33,986     | 32,346     | 2,718     | 2,587     |
| 9               | その他  | 35,850     | 35,110     | 2,868     | 2,808     |
| 10              | CVAリスク   | 406,590    | 440,277    | 32,527    | 35,222    |
|                 | うち、SA-CVA適用分                                     | -          | -          | -         | -         |
|                 | うち、完全なBA-CVA適用分                                  | 406,590    | 440,277    | 32,527    | 35,222    |
|                 | 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           | 750,490    | 717,630    | 60,039    | 57,410    |
| 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)      | 1,868,931  | 1,876,670  | 149,514   | 150,133   |
| 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)        | 1,852,345  | 1,756,869  | 148,187   | 140,549   |
|                 | 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%) | 312        | 305        | 24        | 24        |
| 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               | 529,805    | 492,231    | 42,384    | 39,378    |
| 17              | うち、内部格付手法準拠方式適用分                                 | 503,604    | 464,300    | 40,288    | 37,144    |
| 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                        | 26,201     | 27,930     | 2,096     | 2,234     |
| 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                             | 0          | 0          | 0         | 0         |
| 20              | マーケット・リスク  | 1,099,242  | 1,022,907  | 87,939    | 81,832    |
| 21              | うち、標準的方式適用分                                      | 1,099,242  | 1,022,907  | 87,939    | 81,832    |
| 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                                     | 1,112,755  | 1,068,754  | 89,020    | 85,500    |
| 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                 | 345,305    | 345,996    | 27,624    | 27,679    |
| 26              | フロア調整  | -          | -          | -         | -         |
| 27              | 合計   | 23,955,587 | 23,412,541 | 1,916,446 | 1,873,003 |