

## 株式会社三井住友フィナンシャルグループ（連結）

（単位：百万円）

0V1：リスク・アセットの概要		イ	ロ	ハ	ニ
国際様式の 該当番号		リスク・アセット		所要自己資本	
		2019年6月末	2019年3月末	2019年6月末	2019年3月末
		1	信用リスク	40,390,369	39,966,325
2	うち、標準的手法適用分	2,821,359	2,843,844	225,708	227,507
3	うち、内部格付手法適用分	34,237,411	33,898,986	2,903,332	2,874,634
	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	53,024	52,206	4,241	4,176
	その他	3,278,574	3,171,288	262,285	253,703
4	カウンターパーティ信用リスク	4,321,388	4,111,505	350,829	333,623
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	1,202,421	1,094,827	100,672	91,618
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	2,557,088	2,376,345	204,567	190,107
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	176,157	177,913	14,092	14,233
	その他	385,720	462,418	31,496	37,664
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	764,077	699,163	64,793	59,289
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）	2,316,666	2,107,834	185,333	168,626
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）	—	—	—	—
	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%）	45,437	20,577	3,658	1,669
	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%）	331,373	317,353	28,023	26,834
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1250%）	40,449	41,684	3,235	3,334
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	1,131,645	1,136,269	90,531	90,901
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	970,815	970,149	77,665	77,611
14	うち、外部格付準拠方式適用分	152,270	158,514	12,181	12,681
15	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	8,559	7,605	684	608
16	マーケット・リスク	2,352,419	2,323,156	188,193	185,852
17	うち、標準的方式適用分	741,348	752,059	59,307	60,164
18	うち、内部モデル方式適用分	1,611,070	1,571,096	128,885	125,687
19	オペレーショナル・リスク	3,585,559	3,617,535	286,844	289,402
20	うち、基礎的手法適用分	776,185	776,185	62,094	62,094
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	2,809,373	2,841,349	224,749	227,307
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	2,266,287	2,309,872	192,168	195,867
	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（スケーリングファクター適用後）	59,864,761	58,942,791	4,789,180	4,715,423