

## 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）

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	
		2019年9月末	2019年6月末	2019年9月末	2019年6月末
1	信用リスク	39,860,351	40,390,369	3,351,284	3,395,569
2	うち、標準的手法適用分	2,791,755	2,821,359	223,340	225,708
3	うち、内部格付手法適用分	33,845,124	34,237,411	2,870,066	2,903,332
	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	49,933	53,024	3,994	4,241
	その他	3,173,538	3,278,574	253,883	262,285
4	カウンターパーティ信用リスク	4,805,917	4,321,388	390,046	350,829
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	1,279,508	1,202,421	107,180	100,672
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	2,765,725	2,557,088	221,258	204,567
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	181,046	176,157	14,483	14,092
	その他	579,638	385,720	47,124	31,496
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	783,272	764,077	66,421	64,793
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）	2,213,131	2,316,666	177,050	185,333
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%）	38,472	45,437	3,090	3,658
	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%）	358,487	331,373	30,267	28,023
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%）	28,449	40,449	2,275	3,235
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	1,073,070	1,131,645	85,845	90,531
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	928,234	970,815	74,258	77,665
14	うち、外部格付準拠方式適用分	133,156	152,270	10,652	12,181
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	11,679	8,559	934	684
16	マーケット・リスク	2,535,344	2,352,419	202,827	188,193
17	うち、標準的方式適用分	852,514	741,348	68,201	59,307
18	うち、内部モデル方式適用分	1,682,830	1,611,070	134,626	128,885
19	オペレーショナル・リスク	3,747,389	3,585,559	299,791	286,844
20	うち、基礎的手法適用分	831,888	776,185	66,551	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	2,915,500	2,809,373	233,240	224,749
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	2,255,407	2,266,287	191,247	192,168
	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）	60,001,868	59,864,761	4,800,149	4,789,180