

株式会社三井住友銀行（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	
		2022年6月末	2022年3月末	2022年6月末	2022年3月末
1	信用リスク	43,653,553	41,710,522	3,684,912	3,521,026
2	うち、標準的手法適用分	1,032,647	971,367	82,611	77,709
3	うち、内部格付手法適用分	40,130,830	38,371,815	3,403,094	3,253,929
	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	26,891	30,408	2,151	2,432
	その他	2,463,184	2,336,931	197,054	186,954
4	カウンターパーティ信用リスク	4,290,592	3,964,465	351,408	324,435
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	1,434,069	1,302,103	121,548	110,357
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	2,411,339	2,318,675	192,907	185,494
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	153,985	112,029	12,318	8,962
	その他	291,199	231,657	24,634	19,621
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	994,515	874,084	84,334	74,122
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）	2,143,539	2,195,559	171,483	175,644
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％）	15,455	14,425	1,310	1,223
	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％）	448,383	366,911	37,993	31,085
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％）	88,832	89,694	7,106	7,175
11	未決済取引	253	113	21	9
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	1,391,389	1,409,040	111,311	112,723
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	1,166,833	1,216,667	93,346	97,333
14	うち、外部格付準拠方式適用分	203,785	168,987	16,302	13,519
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	5,163	5,741	413	459
	うち、1250％のリスク・ウェイト適用分	15,606	17,644	1,248	1,411
16	マーケット・リスク	2,742,859	2,212,808	219,428	177,024
17	うち、標準的方式適用分	309,444	241,525	24,755	19,322
18	うち、内部モデル方式適用分	2,433,414	1,971,282	194,673	157,702
19	オペレーショナル・リスク	3,207,801	3,207,032	256,624	256,562
20	うち、基礎的手法適用分	666,299	666,299	53,303	53,303
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	2,541,502	2,540,732	203,320	203,258
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	1,735,604	1,404,532	147,091	119,053
	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	6,836,051	6,119,406	546,884	489,552
25	合計（スケーリングファクター適用後）	70,248,881	66,120,492	5,619,910	5,289,639