

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9月末	2022年6月末	2022年9月末	2022年6月末
1	信用リスク	43,109,891	43,653,553	3,637,698	3,684,912
2	うち、標準的手法適用分	1,105,944	1,032,647	88,475	82,611
3	うち、内部格付手法適用分	39,355,702	40,130,830	3,337,363	3,403,094
	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残残存価額のエクスポージャー	23,821	26,891	1,905	2,151
	その他	2,624,422	2,463,184	209,953	197,054
4	カウンターパーティ信用リスク	5,044,487	4,290,592	413,078	351,408
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	1,728,606	1,434,069	146,525	121,548
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	2,868,119	2,411,339	229,449	192,907
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	172,515	153,985	13,801	12,318
	その他	275,245	291,199	23,301	24,634
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	583,445	994,515	49,476	84,334
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）	2,328,627	2,143,539	186,290	171,483
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%）	12,007	15,455	1,016	1,310
	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%）	509,553	448,383	43,182	37,993
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%）	87,496	88,832	6,999	7,106
11	未決済取引	1,832	253	155	21
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	1,509,852	1,391,389	120,788	111,311
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	1,196,657	1,166,833	95,732	93,346
14	うち、外部格付準拠方式適用分	292,750	203,785	23,420	16,302
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	4,872	5,163	389	413
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	15,571	15,606	1,245	1,248
16	マーケット・リスク	3,033,188	2,742,859	242,655	219,428
17	うち、標準的方式適用分	239,516	309,444	19,161	24,755
18	うち、内部モデル方式適用分	2,793,671	2,433,414	223,493	194,673
19	オペレーショナル・リスク	3,457,129	3,207,801	276,570	256,624
20	うち、基礎的手法適用分	722,863	666,299	57,829	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	2,734,266	2,541,502	218,741	203,320
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	2,113,484	1,735,604	179,070	147,091
	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	7,824,209	6,836,051	625,936	546,884
25	合計（スケーリングファクター適用後）	72,286,492	70,248,881	5,782,919	5,619,910