

株式会社三井住友銀行（単体）

（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	41,995,220	42,612,105	3,554,676	3,607,691
2	うち、標準的手法適用分	—	—	—	—
3	うち、内部格付手法適用分	40,637,298	41,400,628	3,446,042	3,510,773
	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	1,357,921	1,211,476	108,633	96,918
4	カウンターパーティ信用リスク	3,770,967	3,282,277	307,839	268,275
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	1,040,153	895,363	88,205	75,926
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	2,384,848	2,013,799	190,787	161,103
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	102,367	82,296	8,189	6,583
	その他	243,598	290,817	20,657	24,661
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	575,290	987,132	48,784	83,708
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）	2,314,251	2,128,166	185,140	170,253
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%）	10,700	12,499	907	1,059
	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%）	488,507	428,502	41,425	36,337
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%）	51,941	56,479	4,155	4,518
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	1,458,730	1,336,804	116,698	106,944
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	1,172,095	1,137,150	93,767	90,972
14	うち、外部格付準拠方式適用分	281,762	194,490	22,540	15,559
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	—	—	—	—
16	マーケット・リスク	2,003,203	1,801,011	160,256	144,080
17	うち、標準的方式適用分	3,073	3,970	245	317
18	うち、内部モデル方式適用分	2,000,129	1,797,041	160,010	143,763
19	オペレーショナル・リスク	2,448,128	2,304,876	195,850	184,390
20	うち、基礎的手法適用分	—	—	—	—
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	2,448,128	2,304,876	195,850	184,390
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	1,151,671	940,089	97,661	79,719
	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	8,163,072	6,738,994	653,045	539,119
25	合計（スケーリングファクター適用後）	67,080,519	65,326,242	5,366,441	5,226,099