

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12月末	2022年9月末	2022年12月末	2022年9月末
1	信用リスク	42,395,589	43,109,891	3,577,194	3,637,698
2	うち、標準的手法適用分	1,173,643	1,105,944	93,891	88,475
3	うち、内部格付手法適用分	38,655,732	39,355,702	3,278,006	3,337,363
	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	28,372	23,821	2,269	1,905
	その他	2,537,841	2,624,422	203,027	209,953
4	カウンターパーティ信用リスク	4,675,872	5,044,487	382,692	413,078
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	1,423,557	1,728,606	120,662	146,525
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	2,571,078	2,868,119	205,686	229,449
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	206,528	172,515	16,522	13,801
	その他	474,708	275,245	39,820	23,301
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	475,760	583,445	40,344	49,476
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）	2,189,985	2,328,627	175,198	186,290
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%）	13,156	12,007	1,114	1,016
	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%）	545,876	509,553	46,262	43,182
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%）	148,952	87,496	11,916	6,999
11	未決済取引	442	1,832	37	155
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	1,477,615	1,509,852	118,209	120,788
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	1,195,287	1,196,657	95,623	95,732
14	うち、外部格付準拠方式適用分	262,870	292,750	21,029	23,420
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	4,710	4,872	376	389
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	14,746	15,571	1,179	1,245
16	マーケット・リスク	3,298,343	3,033,188	263,867	242,655
17	うち、標準的方式適用分	266,887	239,516	21,351	19,161
18	うち、内部モデル方式適用分	3,031,456	2,793,671	242,516	223,493
19	オペレーショナル・リスク	3,483,610	3,457,129	278,688	276,570
20	うち、基礎的手法適用分	722,863	722,863	57,829	57,829
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	2,760,747	2,734,266	220,859	218,741
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	2,138,844	2,113,484	181,212	179,070
	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	7,339,635	7,824,209	587,170	625,936
25	合計（スケーリングファクター適用後）	70,798,861	72,286,492	5,663,908	5,782,919