

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12月末	2022年9月末	2022年12月末	2022年9月末
1	信用リスク	41,103,964	41,995,220	3,479,353	3,554,676
2	うち、標準的手法適用分	—	—	—	—
3	うち、内部格付手法適用分	39,799,335	40,637,298	3,374,983	3,446,042
	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	1,304,629	1,357,921	104,370	108,633
4	カウンターパーティ信用リスク	3,465,369	3,770,967	283,142	307,839
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	914,452	1,040,153	77,545	88,205
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	2,101,045	2,384,848	168,083	190,787
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	132,363	102,367	10,589	8,189
	その他	317,508	243,598	26,924	20,657
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	467,266	575,290	39,624	48,784
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）	2,174,634	2,314,251	173,970	185,140
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％）	11,838	10,700	1,003	907
	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％）	525,478	488,507	44,560	41,425
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％）	50,749	51,941	4,059	4,155
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	1,420,149	1,458,730	113,611	116,698
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	1,167,752	1,172,095	93,420	93,767
14	うち、外部格付準拠方式適用分	247,686	281,762	19,814	22,540
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	—	—	—	—
16	マーケット・リスク	2,403,111	2,003,203	192,248	160,256
17	うち、標準的方式適用分	5,108	3,073	408	245
18	うち、内部モデル方式適用分	2,398,002	2,000,129	191,840	160,010
19	オペレーショナル・リスク	2,481,876	2,448,128	198,550	195,850
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	2,481,876	2,448,128	198,550	195,850
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	1,225,589	1,151,671	103,929	97,661
	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	7,449,466	8,163,072	595,957	653,045
25	合計（スケーリングファクター適用後）	65,375,184	67,080,519	5,230,014	5,366,441