

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	
		2024年3月末	2023年12月末	2024年3月末	2023年12月末
1	信用リスク	59,323,638		4,745,891	
2	うち、標準的手法適用分	1,398,503		111,880	
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	42,209,315		3,376,745	
4	うち、スロットティング・クライテリア適用分	644,912		51,593	
5	うち、先進的内部格付手法適用分	12,559,150		1,004,732	
	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	23,100		1,848	
	その他	2,488,655		199,092	
6	カウンターパーティ信用リスク	1,922,129		153,770	
7	うち、SA-CCR適用分	1,590,346		127,227	
8	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—		—	
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	28,940		2,315	
9	その他	302,842		24,227	
10	CVAリスク	2,045,772		163,661	
	うち、SA-CVA適用分	—		—	
	うち、完全なBA-CVA適用分	1,815,956		145,276	
	うち、限定的なBA-CVA適用分	229,815		18,385	
11	経過措置により適用されるマーケット・ベース方式に基づく株式等エクスポージャー	2,155,720		172,457	
12	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（ロック・スルー方式）	4,680,461		374,436	
13	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%）	93,981		7,518	
	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%）	472,002		37,760	
14	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%）	515,484		41,238	
15	未決済取引	19		1	
16	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	1,488,838		119,107	
17	うち、内部格付手法準拠方式適用分	1,317,929		105,434	
18	うち、外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分	168,648		13,491	
19	うち、標準的手法準拠方式適用分	2,260		180	
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	—		—	
20	マーケット・リスク	1,792,417		143,393	
21	うち、標準的方式適用分	1,738,948		139,115	
22	うち、内部モデル方式適用分	—		—	
	うち、簡易的方式適用分	53,469		4,277	
23	勘定間の振替分	—		—	
24	オペレーショナル・リスク	3,966,778		317,342	
25	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	2,184,006		174,720	
26	フロア調整	—		—	
27	合計	80,641,252		6,451,300	

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	
		2024年3月末	2023年12月末	2024年3月末	2023年12月末
1	信用リスク		44,114,021		3,721,141
2	うち、標準的手法適用分		1,292,128		103,370
3	うち、内部格付手法適用分		40,004,139		3,392,350
	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		24,631		1,970
	その他		2,793,121		223,449
4	カウンターパーティ信用リスク		4,423,149		362,261
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		1,415,250		119,945
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分		—		—
	うち、CVAリスク		2,366,101		189,288
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー		279,169		22,333
	その他		362,628		30,693
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		1,592,351		135,031
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）		3,466,481		277,318
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%）		46,987		3,971
	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%）		733,501		62,200
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%）		222,184		17,774
11	未決済取引		10		0
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		1,304,026		104,322
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分		1,099,385		87,950
14	うち、外部格付準拠方式適用分		187,741		15,019
15	うち、標準的手法準拠方式適用分		2,708		216
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分		14,191		1,135
16	マーケット・リスク		2,662,355		212,988
17	うち、標準的方式適用分		454,816		36,385
18	うち、内部モデル方式適用分		2,207,539		176,603
19	オペレーショナル・リスク		3,938,287		315,063
20	うち、基礎的手法適用分		883,102		70,648
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		3,055,185		244,414
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		2,269,620		192,372
	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		8,465,546		677,243
25	合計（スケーリングファクター適用後）		76,021,118		6,081,689