

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	
		2023年6月末	2023年3月末	2023年6月末	2023年3月末
1	信用リスク	43,814,453	42,007,632	3,696,583	3,543,896
2	うち、標準的手法適用分	1,194,504	1,130,589	95,560	90,447
3	うち、内部格付手法適用分	39,880,753	38,184,530	3,381,887	3,238,048
	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横残存価額のエクスポージャー	23,173	24,881	1,853	1,990
	その他	2,716,021	2,667,632	217,281	213,410
4	カウンターパーティ信用リスク	4,836,187	4,336,647	395,964	354,917
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	1,501,003	1,319,591	127,229	111,835
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	2,639,310	2,400,268	211,144	192,021
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	284,237	250,428	22,739	20,034
	その他	411,635	366,358	34,851	31,025
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	877,547	782,438	74,416	66,350
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）	3,092,156	2,536,842	247,372	202,947
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%）	47,795	47,648	4,037	4,024
	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%）	460,477	388,692	39,048	32,960
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%）	208,419	207,532	16,673	16,602
11	未決済取引	73	255	6	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	1,319,572	1,311,406	105,565	104,912
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	1,066,657	1,074,905	85,332	85,992
14	うち、外部格付準拠方式適用分	230,859	218,204	18,468	17,456
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	7,857	4,111	628	328
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	14,197	14,184	1,135	1,134
16	マーケット・リスク	2,910,187	3,177,926	232,815	254,234
17	うち、標準的方式適用分	495,680	310,920	39,654	24,873
18	うち、内部モデル方式適用分	2,414,507	2,867,006	193,160	229,360
19	オペレーショナル・リスク	3,609,616	3,607,994	288,769	288,639
20	うち、基礎的手法適用分	779,290	779,290	62,343	62,343
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	2,830,326	2,828,703	226,426	226,296
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	1,666,000	1,616,771	141,205	137,033
	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	8,474,226	7,820,232	677,938	625,618
25	合計（スケーリングファクター適用後）	74,004,955	70,401,996	5,920,396	5,632,159