

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	
		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	42,275,408	40,722,636	3,578,261	3,446,855
2	うち、標準的手法適用分	—	—	—	—
3	うち、内部格付手法適用分	40,881,007	39,384,313	3,466,709	3,339,789
	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	1,394,400	1,338,323	111,552	107,065
4	カウンターパーティ信用リスク	3,558,789	3,262,887	291,043	266,457
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	966,455	845,311	81,955	71,682
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	2,138,888	2,024,238	171,111	161,939
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	98,981	108,042	7,918	8,643
	その他	354,464	285,295	30,058	24,193
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	869,491	774,541	73,732	65,681
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）	3,072,838	2,519,723	245,827	201,577
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%）	43,558	43,305	3,693	3,672
	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%）	449,993	378,562	38,159	32,102
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%）	100,336	98,933	8,026	7,914
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	1,259,911	1,255,452	100,792	100,436
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	1,029,792	1,038,477	82,383	83,078
14	うち、外部格付準拠方式適用分	222,261	212,863	17,780	17,029
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	—	—	—	—
16	マーケット・リスク	1,821,527	2,229,655	145,722	178,372
17	うち、標準的方式適用分	12,770	4,239	1,021	339
18	うち、内部モデル方式適用分	1,808,756	2,225,415	144,700	178,033
19	オペレーショナル・リスク	2,536,301	2,529,600	202,904	202,368
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	2,536,301	2,529,600	202,904	202,368
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	666,568	833,081	56,525	70,645
	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	9,068,022	7,901,999	725,441	632,159
25	合計（スケーリングファクター適用後）	68,376,639	65,103,047	5,470,131	5,208,243