

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9月末	2023年6月末	2023年9月末	2023年6月末
1	信用リスク	44,268,835	43,814,453	3,734,219	3,696,583
2	うち、標準的手法適用分	1,240,188	1,194,504	99,215	95,560
3	うち、内部格付手法適用分	40,148,509	39,880,753	3,404,593	3,381,887
	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	24,628	23,173	1,970	1,853
	その他	2,855,509	2,716,021	228,440	217,281
4	カウンターパーティ信用リスク	4,769,208	4,836,187	390,560	395,964
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	1,540,052	1,501,003	130,510	127,229
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	2,525,413	2,639,310	202,033	211,144
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	333,594	284,237	26,687	22,739
	その他	370,148	411,635	31,329	34,851
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	1,464,263	877,547	124,169	74,416
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）	3,413,516	3,092,156	273,081	247,372
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%）	61,069	47,795	5,164	4,037
	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%）	698,166	460,477	59,203	39,048
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%）	217,878	208,419	17,430	16,673
11	未決済取引	36	73	3	6
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	1,327,517	1,319,572	106,201	105,565
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	1,086,171	1,066,657	86,893	85,332
14	うち、外部格付準拠方式適用分	224,076	230,859	17,926	18,468
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	3,074	7,857	245	628
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	14,195	14,197	1,135	1,135
16	マーケット・リスク	2,597,388	2,910,187	207,791	232,815
17	うち、標準的方式適用分	532,042	495,680	42,563	39,654
18	うち、内部モデル方式適用分	2,065,345	2,414,507	165,227	193,160
19	オペレーショナル・リスク	3,846,458	3,609,616	307,716	288,769
20	うち、基礎的手法適用分	883,102	779,290	70,648	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	2,963,355	2,830,326	237,068	226,426
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	1,969,559	1,666,000	166,952	141,205
	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	8,633,010	8,474,226	690,640	677,938
25	合計（スケーリングファクター適用後）	76,039,182	74,004,955	6,083,134	5,920,396