

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12月末	2023年9月末	2023年12月末	2023年9月末
1	信用リスク	44,114,021	44,268,835	3,721,141	3,734,219
2	うち、標準的手法適用分	1,292,128	1,240,188	103,370	99,215
3	うち、内部格付手法適用分	40,004,139	40,148,509	3,392,350	3,404,593
	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	24,631	24,628	1,970	1,970
	その他	2,793,121	2,855,509	223,449	228,440
4	カウンターパーティ信用リスク	4,423,149	4,769,208	362,261	390,560
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	1,540,052	119,945	130,510
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	2,525,413	189,288	202,033
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	279,169	333,594	22,333	26,687
	その他	362,628	370,148	30,693	31,329
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	1,464,263	135,031	124,169
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	3,413,516	277,318	273,081
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	61,069	3,971	5,164
	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	698,166	62,200	59,203
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	217,878	17,774	17,430
11	未決済取引	10	36	0	3
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	1,327,517	104,322	106,201
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	1,086,171	87,950	86,893
14	うち、外部格付準拠方式適用分	187,741	224,076	15,019	17,926
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	2,708	3,074	216	245
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	14,191	14,195	1,135	1,135
16	マーケット・リスク	2,662,355	2,597,388	212,988	207,791
17	うち、標準的方式適用分	454,816	532,042	36,385	42,563
18	うち、内部モデル方式適用分	2,207,539	2,065,345	176,603	165,227
19	オペレーショナル・リスク	3,938,287	3,846,458	315,063	307,716
20	うち、基礎的手法適用分	883,102	883,102	70,648	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	2,963,355	244,414	237,068
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	1,969,559	192,372	166,952
	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	8,633,010	677,243	690,640
25	合計（スケーリングファクター適用後）	76,021,118	76,039,182	6,081,689	6,083,134