

内部モデル方式を適用して算出されたマーケットリスク・アセットの額の変動要因(2021年3月期第2四半期)

【三井住友信託銀行】

(連結・国際統一基準)

(単位:十億円)

MR2:内部モデル方式を適用して算出されたリスク・アセットの額の変動要因							
項番		イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ
		バリュエーション・リスク	ストレス・バリュエーション・リスク	追加的リスク	包括的リスク	その他	合計
1a	前四半期末におけるリスク・アセット	326	949	-	-		1,275
1b	前四半期末における自己資本比率規制上のリスク・アセット額への調整	3.83	2.86	-	-		3.06
1c	前四半期末の算出基準日における内部モデル方式の算出額	85	331	-	-		416
2	当四半期中の要因別の変動額	リスク量の変動	△14	15	-	-	1
3		モデルの更新又は変更	-	-	-	-	-
4		手法及び方針	-	-	-	-	-
5		買収及び売却	-	-	-	-	-
6		為替の変動	△0	△5	-	-	△5
7		その他	△7	△8	-	-	△15
8a		当四半期末の算出基準日における内部モデル方式の算出額	63	333	-	-	
8b	当四半期末における自己資本比率規制上のリスク・アセット額への調整	3.53	3.25	-	-		3.29
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	224	1,084	-	-		1,309

(注)

前四半期末:2020年6月末、当四半期末:2020年9月末