

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(2022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	403	1,292	-	-		1,696	
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	5.41	3.90	-	-		4.17	
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	74	331	-	-		405	
2	当四半期中の要因別の変動額	リスク量の変動	19	64	-	-		83
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	4	1	-	-		6
7		その他	△6	2	-	-		△4
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	91	400	-	-		491
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	2.89	3.38	-	-		3.29	
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	263	1,354	-	-		1,618	

(注)

前四半期末:2021年6月末、当四半期末:2021年9月末