

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4四半期)

【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	ストレステスト・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	352	1,466	-	-		1,818	
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	3.21	3.76	-	-		3.64	
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	109	389	-	-		499	
2	当四半期中の要因別の変動額	リスク量の変動	△4	△66	-	-		△71
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	2	△4	-	-		△2
7		その他	0	△63	-	-		△62
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	106	255	-	-		362	
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	2.58	3.74	-	-		3.40	
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	275	959	-	-		1,234	

(注)

前四半期末:2021年12月末、当四半期末:2022年3月末