

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(2023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	320	1,027	-	-		1,348
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	2.25	2.75	-	-		2.61
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	142	372	-	-		515
2	当四半期中の要因別の変動額	リスク量の変動	△33	△45	-	-	△79
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	9	16	-	-	26
7		その他	45	76	-	-	121
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	163	420	-	-		584
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	2.13	2.15	-	-		2.15
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	349	907	-	-		1,256

(注)

前四半期末:2022年6月末、当四半期末:2022年9月末