

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3四半期)

【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	349	907	-	-		1,256	
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	2.13	2.15	-	-		2.15	
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	163	420	-	-		584	
2	当四半期中の要因別の変動額	リスク量の変動	△2	102	-	-		100
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	10	-	-		7
7		その他	16	△26	-	-		△10
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	175	507	-	-		682	
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	3.10	2.70	-	-		2.80	
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	542	1,372	-	-		1,915	

(注)

前四半期末:2022年9月末、当四半期末:2022年12月末