

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(2024年3月期第1四半期)

【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	451	1,305	-	-		1,756	
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	3.94	4.31	-	-		4.21	
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	114	302	-	-		416	
2	当四半期中の要因別の変動額	リスク量の変動	45	36	-	-		82
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	△7	△11	-	-		△18
7		その他	△14	28	-	-		14
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	137	357	-	-		494	
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	3.22	2.99	-	-		3.06	
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	443	1,071	-	-		1,514	

(注)

前四半期末:2023年3月末、当四半期末:2023年6月末