

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                | 494          | 1,208                | -      | -      |     | 1,703 |      |
| 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         | 2.55                 | -      | -      |     | 2.84  |      |
| 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       | 125          | 473                  | -      | -      |     | 598   |      |
| 2                                    | 当四半期中の要因別の変動額                    | リスク量の変動      | △15                  | △119   | -      | -   |       | △134 |
| 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     | -      | -   |       | 13   |
| 7                                    |                                  | その他          | 0                    | 16     | -      | -   |       | 16   |
| 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       | 113          | 381                  | -      | -      |     | 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 | 3.54         | 3.26                 | -      | -      |     | 3.33  |      |
| 8c                                   | 当四半期末におけるリスク・アセット                | 401          | 1,247                | -      | -      |     | 1,648 |      |

(注)

前四半期末:2023年9月末、当四半期末:2023年12月末