

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(2021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	224	1,084	-	-		1,309	
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	3.53	3.25	-	-		3.29	
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	63	333	-	-		397	
2	当四半期中の要因別の変動額	リスク量の変動	30	△18	-	-		11
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	6	11	-	-		17
7		その他	40	△9	-	-		31
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	141	317	-	-		458
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	2.82	3.72	-	-		3.44	
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	399	1,181	-	-		1,580	

(注)

前四半期末:2020年9月末、当四半期末:2020年12月末