

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(2020年3月期第4四半期)

【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	243	1,041	-	-		1,285	
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	2.51	4.36	-	-		3.83	
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	96	238	-	-		335	
2	当四半期中の要因別の変動額	リスク量の変動	△6	37	-	-		30
3		モデルの更新又は変更	-	-	-	-		0
4		手法及び方針	-	-	-	-		0
5		買収及び売却	-	-	-	-		0
6		為替の変動	△8	△2	-	-		△11
7		その他	28	△0	-	-		28
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	110	272	-	-		382	
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	2.69	3.72	-	-		3.42	
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	297	1,013	-	-		1,311	

(注)

前四半期末:2019年12月末、当四半期末:2020年3月末