

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(2022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・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	365	1,039	-	-		1,405	
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	3.13	3.08	-	-		3.09	
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	116	336	-	-		453	
2	当四半期中の要因別の変動額	リスク量の変動	36	△9	-	-		27
3		モデルの更新又は変更	△33	49	-	-		15
4		手法及び方針	-	-	-	-		-
5		買収及び売却	-	-	-	-		-
6		為替の変動	△4	△11	-	-		△15
7		その他	△41	△33	-	-		△74
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	74	331	-	-		405
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	5.41	3.90	-	-		4.17	
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	403	1,292	-	-		1,696	

(注)

前四半期末:2021年3月末、当四半期末:2021年6月末