

株式会社三井住友銀行（連結）

（単位：千億円）

CR8：内部格付手法を適用した信用リスク・エクスポージャーのリスク・アセット変動表			
項番		信用リスク・アセットの額	
1	前四半期末時点における信用リスク・アセットの額	337	
2	当期中の 要因別の 変動額	資産の規模	11
3		ポートフォリオの質	3
4		モデルの更新	—
5		手法及び方針	—
6		買収又は売却	—
7		為替の変動	0
8		その他	—
9	当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	352	

(注) 項番5「手法及び方針」には、当局による規制の変更又は新たな規制の導入等による計算手法の変更に起因する信用リスク・アセットの額の変動額を記載しております。

株式会社三井住友銀行（連結）

（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	488	1,195	—	—		1,684
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	2.3	3.1	—	—		2.8
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	204	384	—	—		589
2	当四半期中の要因別の変動額	リスク量の変動	△ 56	△ 59	—	—	△ 116
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	5	△ 9	—	—	△ 4
7	その他	△ 11	—	—	—	△ 11	
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	142	315	—	—		457
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	3.5	3.3	—	—		3.3
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	499	1,041	—	—		1,540

(注1) 項番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」は項番1aの項に計上される額を項番1cの項に計上される額で除して得た値です。また、項番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」は、項番8cの項に計上される額を項番8aの項に計上される額で除して得た値です。

(注2) 当四半期中の要因別の変動額のうち「7.その他」は、モデルに使用する観測データを更新したことによる影響額です。