

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1四半期)
【三井住友トラスト・ホールディングス】
 (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	297	1,013	-	-		1,311	
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	2.69	3.72	-	-		3.42	
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	110	272	-	-		382	
2	当四半期中の要因別の変動額	リスク量の変動	△5	44	-	-		39
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	△1	0	-	-		△0
7		その他	△18	13	-	-		△4
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	85	331	-	-		416
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	3.83	2.86	-	-		3.06	
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	326	949	-	-		1,275	

(注)

前四半期末:2020年3月末、当四半期末:2020年6月末