

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(2023年3月期第3四半期)
【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 | 349 | 907 | - | - | | 1,256 | |
| 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 | 2.13 | 2.15 | - | - | | 2.15 | |
| 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 | 163 | 420 | - | - | | 584 | |
| 2 | 当四半期中の要因別の変動額 | リスク量の変動 | △2 | 102 | - | - | | 100 |
| 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 | △2 | 10 | - | - | | 7 |
| 7 | | その他 | 16 | △26 | - | - | | △10 |
| 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 | 175 | 507 | - | - | | 682 | |
| 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 | 3.10 | 2.70 | - | - | | 2.80 | |
| 8c | 当四半期末におけるリスク・アセット | 542 | 1,372 | - | - | | 1,915 | |

(注)

前四半期末:2022年9月末、当四半期末:2022年12月末