

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(2024年3月期第2四半期)
【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	443	1,071	-	-		1,514	
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	3.22	2.99	-	-		3.06	
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	137	357	-	-		494	
2	当四半期中の要因別の変動額	リスク量の変動	△10	81	-	-		71
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	3	5	-	-		9
7		その他	△5	28	-	-		23
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	125	473	-	-		598	
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	3.94	2.55	-	-		2.84	
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	494	1,208	-	-		1,703	

(注)

前四半期末:2023年6月末、当四半期末:2023年9月末