

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(2019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	243	749	-	-		993	
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	4.06	3.46	-	-		3.59	
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	59	216	-	-		276	
2	当四半期中の要因別の変動額	リスク量の変動	7	42	-	-		50
3		モデルの更新又は変更	-	-	-	-		0
4		手法及び方針	-	-	-	-		0
5		買収及び売却	-	-	-	-		0
6		為替の変動	△0	△1	-	-		△1
7		その他	0	2	-	-		2
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	67	259	-	-		327	
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	3.97	3.09	-	-		3.28	
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	270	804	-	-		1,074	

(注)

前四半期末:2018年3月末、当四半期末:2018年6月末