

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	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