

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	270	804	-	-		1,074
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	3.97	3.09	-	-		3.28
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	67	259	-	-		327
2	当四半期中の要因別の変動額	リスク量の変動	△6	17	-	-	11
3		モデルの更新又は変更	9	△34	-	-	△25
4		手法及び方針	-	-	-	-	0
5		買収及び売却	-	-	-	-	0
6		為替の変動	4	10	-	-	14
7		その他	△8	18	-	-	9
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	66	270	-	-	
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	4.21	3.04	-	-		3.27
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	280	825	-	-		1,105

(注)

前四半期末:2018年6月末、当四半期末:2018年9月末