

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	280	825	-	-		1,105	
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	4.21	3.04	-	-		3.27	
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	66	270	-	-		337	
2	当四半期中の要因別の変動額	リスク量の変動	9	11	-	-		21
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	1	△13	-	-		△12
7		その他	2	59	-	-		62
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	79	328	-	-		408	
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	3.07	3.22	-	-		3.19	
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	245	1,059	-	-		1,304	

(注)

前四半期末:2018年9月末、当四半期末:2018年12月末