

## 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(三菱UFJ信託銀行・連結)

(単位:百万円)

項番	前四半期末:2023年6月末 当四半期末:2023年9月末	イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	
		バリュー・ アット・ リスク	ストレス・ バリュー・ アット・ 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	387,084	482,996	—	—		870,081	
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	3.06	2.63	—	—		2.81	
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	126,238	183,014	—	—		309,252	
2	当四半期中の要因別の変動額	リスク量の変動	3,442	△ 21,858	—	—		△ 18,416
3		モデルの更新又は変更	0	0	—	—		0
4		手法及び方針	0	0	—	—		0
5		買収及び売却	0	0	—	—		0
6		為替の変動	△ 984	2,981	—	—		1,996
7		その他	△ 121	△ 43	—	—		△ 164
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	128,574	164,094	—	—		292,668	
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	2.60	2.58	—	—		2.59	
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	335,125	424,703	—	—		759,828	