

## 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9月末 当四半期末:2023年12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	335,125	424,703	—	—		759,828
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	2.60	2.58	—	—		2.59
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	128,574	164,094	—	—		292,668
2	当四半期中の要因別の変動額	リスク量の変動	△ 44,400	△ 47,404	—	—	△ 91,804
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	△ 5,628	374	—	—	△ 5,253
7		その他	740	△ 27,899	—	—	△ 27,159
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	79,285	89,164	—	—		168,450
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	4.04	4.06	—	—		4.05
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	320,481	362,081	—	—		682,563