

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:2018年3月末 当四半期末:2018年6月末 | イ | ロ | ハ | ニ | ホ | ヘ |
|----|----------------------------------|--------------------------|--------------------------------------|------------|------------|-----|-----------|
| | | バリュエーション・ アット・ リスク | ストレステスト・ バリュエーション・ 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 | 406,595 | 1,178,991 | - | - | | 1,585,586 |
| 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 | 2.67 | 2.76 | - | - | | 2.74 |
| 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 | 151,744 | 426,460 | - | - | | 578,204 |
| 2 | 当四半期中の要因別の変動額 | リスク量の変動 | △ 4,896 | △ 11,065 | - | - | △ 15,961 |
| 3 | | モデルの更新又は変更 | - | - | - | - | - |
| 4 | | 手法及び方針 | - | - | - | - | - |
| 5 | | 買収及び売却 | - | - | - | - | - |
| 6 | | 為替の変動 | △ 2,809 | △ 6,495 | - | - | △ 9,305 |
| 7 | | その他 | 449 | △ 31 | - | - | 417 |
| 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 | 144,486 | 408,867 | - | - | | 553,354 |
| 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 | 3.11 | 3.11 | - | - | | 3.11 |
| 8c | 当四半期末におけるリスク・アセット | 450,545 | 1,272,567 | - | - | | 1,723,112 |