

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12月末 当四半期末:2019年3月末	イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ
		バリュウ・ アツ・ リスク	ストレス・ バリュウ・ アツ・ 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	390,356	1,145,014	-	-		1,535,370
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	2.82	2.79	-	-		2.80
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	137,948	410,248	-	-		548,196
2	当四半期中の要因別の変動額	リスク量の変動	△ 90,784	△ 261,896	-	-	△ 352,681
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	105	1,841	-	-	1,947
7		その他	133	△ 383	-	-	△ 250
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	47,402	149,810	-	-		197,212
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	6.41	6.12	-	-		6.19
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	303,876	918,028	-	-		1,221,905