

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:2019年3月末 当四半期末:2019年6月末	イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	
		バリュウ・ アット・ リスク	ストレス・ バリュウ・ 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	303,876	918,028	-	-		1,221,905	
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	6.41	6.12	-	-		6.19	
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	47,402	149,810	-	-		197,212	
2	当四半期中の要因別の変動額	リスク量の変動	7,523	140,173	-	-		147,697
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	△ 7,897	22,483	-	-		14,586
7		その他	△ 185	1,180	-	-		994
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	46,843	313,647	-	-		360,490	
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	3.08	2.21	-	-		2.33	
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	144,359	696,048	-	-		840,408	