

## 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6月末 当四半期末:2019年9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	144,359	696,048	-	-		840,408
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	3.08	2.21	-	-		2.33
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	46,843	313,647	-	-		360,490
2	当四半期中の要因別の変動額	リスク量の変動	△ 4,766	△ 103,781	-	-	△ 108,548
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	△ 403	△ 2,215	-	-	△ 2,618
7		その他	△ 68	654	-	-	585
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	41,604	208,304	-	-		249,908
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	3.23	3.37	-	-		3.35
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	134,719	703,689	-	-		838,408