

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:2020年12月末 当四半期末:2021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	123,238	457,776	0	0		581,014	
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	2.80	2.66	0	0		2.69	
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	43,898	171,749	0	0		215,648	
2	当四半期中の要因別の変動額	リスク量の変動	△ 10,165	△ 110,443	0	0		△ 120,609
3		モデルの更新又は変更	0	0	0	0		0
4		手法及び方針	0	0	0	0		0
5		買収及び売却	0	0	0	0		0
6		為替の変動	286	1,830	0	0		2,117
7		その他	114	△ 676	0	0		△ 561
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	34,134	62,459	0	0		96,594	
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	3.37	6.12	0	0		5.15	
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	115,215	382,639	0	0		497,854	