

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:2021年3月末 当四半期末:2021年6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	115,215	382,639	-	-		497,854	
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	3.37	6.12	-	-		5.15	
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	34,134	62,459	-	-		96,594	
2	当四半期中の要因別の変動額	リスク量の変動	15,794	129,085	-	-		144,880
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	△ 2,332	△ 1,658	-	-		△ 3,990
7		その他	△ 335	392	-	-		56
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	47,260	190,279	-	-		237,540	
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	3.34	3.06	-	-		3.12	
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	158,042	583,843	-	-		741,885	