

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12月末 当四半期末:2022年3月末	イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ
		バリュウ・ アツト・ リスク	ストレス・ バリュウ・ アツト・ 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	115,284	395,972	-	-		511,256
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	2.79	2.88	-	-		2.85
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	41,306	137,471	-	-		178,777
2	当四半期中の要因別の変動額	リスク量の変動	3,195	△ 40,941	-	-	△ 37,745
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	2,852	1,162	-	-	4,015
7		その他	△ 1,789	1,567	-	-	△ 221
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	45,564	99,260	-	-		144,825
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	2.86	4.23	-	-		3.80
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	130,472	420,487	-	-		550,959