

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:2022年3月末 当四半期末:2022年6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	130,472	420,487	—	—		550,959	
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	2.86	4.23	—	—		3.80	
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	45,564	99,260	—	—		144,825	
2	当四半期中の要因別の変動額	リスク量の変動	8,947	45,492	—	—		54,440
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	4,171	1,206	—	—		5,378
7		その他	△ 509	413	—	—		△ 96
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	58,173	146,374	—	—		204,548	
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	2.76	2.57	—	—		2.63	
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	160,602	377,389	—	—		537,991	