

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6月末 当四半期末:2022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	160,602	377,389	-	-		537,991
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	2.76	2.57	-	-		2.63
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	58,173	146,374	-	-		204,548
2	当四半期中の要因別の変動額	リスク量の変動	△ 7,976	△ 18,384	-	-	△ 26,361
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	914	△ 834	-	-	80
7		その他	249	△ 394	-	-	△ 144
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	51,361	126,760	-	-		178,121
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	3.42	3.20	-	-		3.26
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	175,760	405,708	-	-		581,468