

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12月末 当四半期末:2023年3月末	イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ
		バリュエーション・ アセット・ リスク	ストレステスト・ バリュエーション・ アセット・ 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	128,985	252,122	-	-		381,107
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	2.54	2.33	-	-		2.40
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	50,676	107,890	-	-		158,567
2	当四半期中の要因別の変動額	リスク量の変動	29,690	42,198	-	-	71,889
3		モデルの更新又は変更	0	0	-	-	0
4		手法及び方針	0	0	-	-	0
5		買収及び売却	0	0	-	-	0
6		為替の変動	2,615	239	-	-	2,855
7		その他	△ 3,737	△ 8	-	-	△ 3,745
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	79,245	150,320	-	-		229,565
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	2.70	2.46	-	-		2.54
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	214,083	370,638	-	-		584,721