

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:2023年3月末 当四半期末:2023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	214,083	370,638	—	—		584,721	
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	2.70	2.46	—	—		2.54	
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	79,245	150,320	—	—		229,565	
2	当四半期中の要因別の変動額	リスク量の変動	40,175	22,531	—	—		62,706
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	7,791	10,175	—	—		17,967
7		その他	△ 974	△ 13	—	—		△ 987
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	126,238	183,014	—	—		309,252	
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	3.06	2.63	—	—		2.81	
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	387,084	482,996	—	—		870,081	