

## 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:2018年6月末 当四半期末:2018年9月末	イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ
		バリュエーション・ アット・ リスク	ストレス・ バリュエーション・ アット・ 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	450,545	1,272,567	—	—		1,723,112
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	3.11	3.11	—	—		3.11
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	144,486	408,867	—	—		553,354
2	当四半期中の要因別の変動額	リスク量の変動	△ 7,594	△ 19,689	—	—	△ 27,283
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	△ 2,826	4,656	—	—	1,829
7		その他	452	△ 49	—	—	402
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	134,518	393,784	—	—	
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	3.16	3.09	—	—		3.11
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	425,913	1,220,498	—	—		1,646,412