

## 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9月末 当四半期末:2018年12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	425,913	1,220,498	—	—		1,646,412	
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	3.16	3.09	—	—		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	134,518	393,784	—	—		528,303	
2	当四半期中の要因別の変動額	リスク量の変動	8,533	34,680	—	—		43,213
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	△ 5,208	△ 18,172	—	—		△ 23,380
7		その他	104	△ 44	—	—		60
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	137,948	410,248	—	—		548,196	
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	2.82	2.79	—	—		2.80	
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	390,356	1,145,014	—	—		1,535,370	