

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:2020年3月末 当四半期末:2020年6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	101,498	296,395	-	-		397,893
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	2.67	3.06	-	-		2.95
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	38,014	96,804	-	-		134,818
2	当四半期中の要因別の変動額	リスク量の変動	△ 4,697	△ 16,375	-	-	△ 21,072
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	716	1,738	-	-	2,454
7		その他	△ 1,222	△ 81	-	-	△ 1,304
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	32,810	82,086	-	-		114,896
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	3.50	3.46	-	-		3.47
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	115,064	284,613	-	-		399,677