

## 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6月末 当四半期末:2020年9月末	イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	
		バリュウ・ アツト・ リスク	ストレス・ バリュウ・ アツト・ 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	115,064	284,613	-	-		399,677	
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	3.50	3.46	-	-		3.47	
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	32,810	82,086	-	-		114,896	
2	当四半期中の要因別の変動額	リスク量の変動	1,641	48,268	-	-		49,910
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	558	△ 444	-	-		114
7		その他	△ 101	503	-	-		401
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	34,909	130,414	-	-		165,323	
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	3.12	2.90	-	-		2.95	
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	109,036	378,741	-	-		487,777	