

## 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9月末 当四半期末:2020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	109,036	378,741	-	-		487,777	
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	3.12	2.90	-	-		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	34,909	130,414	-	-		165,323	
2	当四半期中の要因別の変動額	リスク量の変動	7,953	36,709	-	-		44,662
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	927	4,968	-	-		5,896
7		その他	108	△ 342	-	-		△ 234
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	43,898	171,749	-	-		215,648	
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	2.80	2.66	-	-		2.69	
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	123,238	457,776	-	-		581,014	