

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:2021年6月末 当四半期末:2021年9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	158,042	583,843	-	-		741,885
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	3.34	3.06	-	-		3.12
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	47,260	190,279	-	-		237,540
2	当四半期中の要因別の変動額	リスク量の変動	△ 14,504	△ 63,419	-	-	△ 77,923
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	△ 481	△ 1,860	-	-	△ 2,342
7		その他	△ 271	1,205	-	-	933
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	32,003	126,205	-	-		158,208
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	2.91	-	-		2.95
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	99,943	368,128	-	-		468,072