

## 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9月末 当四半期末:2021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	99,943	368,128	-	-		468,072	
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	2.91	-	-		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	32,003	126,205	-	-		158,208	
2	当四半期中の要因別の変動額	リスク量の変動	8,315	10,003	-	-		18,318
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	922	1,097	-	-		2,020
7		その他	64	165	-	-		230
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	41,306	137,471	-	-		178,777	
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	2.79	2.88	-	-		2.85	
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	115,284	395,972	-	-		511,256	