

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銀行・連結)

(単位:百万円)

| 項番 | 前四半期末:2022年9月末 当四半期末:2022年12月末 | イ | ロ | ハ | ニ | ホ | ヘ | |
|----|-----------------------------------|----------------------------|-----------------------------------|------------|------------|-----|-----------|----------|
| | | バリュエーション・ アット・ リスク | ストレス・ バリュエーション・ アット・ 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 | 577,730 | 981,390 | — | — | | 1,559,121 | |
| 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 | 5.03 | 3.62 | — | — | | 4.04 | |
| 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 | 114,741 | 270,566 | — | — | | 385,307 | |
| 2 | 当四半期中の要因別の変動額 | リスク量の変動 | 14,318 | 119,449 | — | — | | 133,768 |
| 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 | 5,499 | △ 18,043 | — | — | | △ 12,543 |
| 7 | | その他 | △ 10,134 | 54,474 | — | — | | 44,339 |
| 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 | 124,425 | 426,446 | — | — | | 550,871 |
| 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 | 3.42 | 2.38 | — | — | | 2.61 | |
| 8c | 当四半期末におけるリスク・アセット | 426,238 | 1,016,848 | — | — | | 1,443,087 | |