

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12月末 当四半期末:2023年3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	426,238	1,016,848	—	—		1,443,087	
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	3.42	2.38	—	—		2.61	
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	124,425	426,446	—	—		550,871	
2	当四半期中の要因別の変動額	リスク量の変動	26,951	89,614	—	—		116,565
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	△ 46,171	5,299	—	—		△ 40,872
7		その他	65,957	△ 43,926	—	—		22,030
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	171,162	477,433	—	—		648,595
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	2.25	2.79	—	—		2.65	
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	386,022	1,336,734	—	—		1,722,756	