

## 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フィナンシャル・グループ)

(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	1,185,657	2,797,455	—	—		3,983,112	
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	3.00	3.03	—	—		3.02	
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	394,849	921,953	—	—		1,316,803	
2	当四半期中の要因別の変動額	リスク量の変動	208,645	200,271	—	—		408,916
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	△ 1,343	△ 9,162	—	—		△ 10,506
7		その他	△ 164,622	283,868	—	—		119,246
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	437,528	1,396,931	—	—		1,834,460
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	3.00	2.81	—	—		2.85	
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	1,316,278	3,929,471	—	—		5,245,750	