

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:2023年6月末 当四半期末:2023年9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	416,745	1,537,061	—	—		1,953,807	
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	2.50	4.29	—	—		3.72	
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	166,506	357,950	—	—		524,456	
2	当四半期中の要因別の変動額	リスク量の変動	46,084	△ 4,582	—	—		41,501
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	△ 37,638	10,034	—	—		△ 27,604
7		その他	△ 5,411	22,466	—	—		17,055
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	169,540	385,867	—	—		555,408
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	2.04	2.69	—	—		2.49	
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	347,191	1,040,186	—	—		1,387,377	