

## 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: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	1,398,193	4,919,450	—	—		6,317,643
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	3.20	4.23	—	—		3.94
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	436,876	1,162,715	—	—		1,599,592
2	当四半期中の要因別の変動額	リスク量の変動	972,858	459,272	—	—	1,432,130
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	△ 23,358	82,490	—	—	59,131
7		その他	△ 895,997	263,165	—	—	△ 632,831
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	490,378	1,967,643	—	—	2,458,022
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	3.17	2.67	—	—	2.77	
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	1,556,293	5,270,468	—	—	6,826,762	