

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:2018年3月末 当四半期末:2018年6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	137,860	468,356	—	—		606,217	
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	2.91	2.37	—	—		2.47	
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	47,287	197,614	—	—		244,901	
2	当四半期中の要因別の変動額	リスク量の変動	18,662	△ 44,187	—	—		△ 25,524
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	△ 3,749	9,335	—	—		5,585
7		その他	4,300	△ 8,857	—	—		△ 4,556
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	66,500	153,905	—	—		220,405	
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	2.53	3.29	—	—		3.06	
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	168,297	506,452	—	—		674,749	