

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: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・ アセット・ リスク | ストレステスト・ バリュエーション・ アセット・ 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 | 588,579 | 1,181,123 | — | — | | 1,769,703 |
| 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 | 2.89 | 2.55 | — | — | | 2.65 |
| 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 | 203,318 | 462,160 | — | — | | 665,479 |
| 2 | 当四半期中の要因別の変動額 | リスク量の変動 | △ 19,485 | △ 35,176 | — | — | △ 54,661 |
| 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 | 15,426 | 5,344 | — | — | 20,771 |
| 7 | | その他 | △ 9,024 | 6,944 | — | — | △ 2,080 |
| 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 | 190,235 | 439,273 | — | — | | 629,508 |
| 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 | 3.16 | 3.34 | — | — | | 3.29 |
| 8c | 当四半期末におけるリスク・アセット | 601,367 | 1,471,173 | — | — | | 2,072,541 |