

## 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・ アット・ リスク	ストレステスト・ 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	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