

## 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:2019年3月末 当四半期末:2019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	189,783	615,914	—	—		805,698	
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	2.08	1.94	—	—		1.97	
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	91,004	316,134	—	—		407,138	
2	当四半期中の要因別の変動額	リスク量の変動	38,332	73,625	—	—		111,957
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	3,222	△ 10,995	—	—		△ 7,773
7		その他	△ 3,622	△ 10,872	—	—		△ 14,495
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	128,936	367,891	—	—		496,827
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	2.60	2.61	—	—		2.61	
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	335,679	962,590	—	—		1,298,270	