

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12月末 当四半期末:2020年3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	293,163	1,049,205	—	—		1,342,369
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	3.34	2.63	—	—		2.76
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	87,595	397,766	—	—		485,361
2	当四半期中の要因別の変動額	リスク量の変動	△ 17,395	△ 112,684	—	—	△ 130,079
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	27,148	△ 26,556	—	—	592
7		その他	△ 12,171	6,346	—	—	△ 5,825
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	85,176	264,872	—	—	
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	3.61	4.71	—	—		4.44
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	307,691	1,247,920	—	—		1,555,612