

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:2020年3月末 当四半期末:2020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	307,691	1,247,920	—	—		1,555,612	
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	3.61	4.71	—	—		4.44	
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	85,176	264,872	—	—		350,048	
2	当四半期中の要因別の変動額	リスク量の変動	23,435	44,459	—	—		67,895
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	10,276	△ 9,750	—	—		526
7		その他	△ 2,548	14,809	—	—		12,261
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	116,341	314,391	—	—		430,732
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	3.11	3.43	—	—		3.34	
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	361,997	1,079,651	—	—		1,441,649	