

## 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6月末<br>当四半期末:2020年9月末 | イ                          | ロ                                 | ハ          | ニ          | ホ         | ヘ         |
|----|----------------------------------|----------------------------|-----------------------------------|------------|------------|-----------|-----------|
|    |                                  | バリュエーション・<br>アット・<br>リスク   | ストレス・<br>バリュエーション・<br>アット・<br>リスク | 追加的<br>リスク | 包括的<br>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                | 361,997                    | 1,079,651                         | —          | —          |           | 1,441,649 |
| 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 | 3.11                       | 3.43                              | —          | —          |           | 3.34      |
| 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       | 116,341                    | 314,391                           | —          | —          |           | 430,732   |
| 2  | 当四半期中の要因別の変動額                    | リスク量の変動                    | △ 8,288                           | 105,031    | —          | —         | 96,743    |
| 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                      | 679                               | △ 42,125   | —          | —         | △ 41,446  |
| 7  |                                  | その他                        | △ 24,359                          | 54,370     | —          | —         | 30,011    |
| 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 | 84,372                            | 431,668    | —          | —         | 516,040   |
| 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 | 4.33                       | 3.16                              | —          | —          | 3.35      |           |
| 8c | 当四半期末におけるリスク・アセット                | 365,615                    | 1,364,494                         | —          | —          | 1,730,110 |           |