

## 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:2021年3月末<br>当四半期末:2021年6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                | 246,925                    | 1,209,988                         | —          | —          |     | 1,456,914 |          |
| 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 | 2.73                       | 2.64                              | —          | —          |     | 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       | 90,436                     | 457,722                           | —          | —          |     | 548,159   |          |
| 2  | 当四半期中の要因別の変動額                    | リスク量の変動                    | 7,097                             | 178,097    | —          | —   |           | 185,195  |
| 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                      | 4,606                             | △ 49,704   | —          | —   |           | △ 45,097 |
| 7  |                                  | その他                        | △ 3,609                           | 39,847     | —          | —   |           | 36,237   |
| 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 | 98,532                            | 625,963    | —          | —   |           | 724,495  |
| 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 | 4.30                       | 2.41                              | —          | —          |     | 2.67      |          |
| 8c | 当四半期末におけるリスク・アセット                | 424,130                    | 1,512,582                         | —          | —          |     | 1,936,712 |          |