

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フィナンシャル・グループ)

(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	440,428	1,585,193	—	—		2,025,621	
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	2.55	3.23	—	—		3.06	
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	172,111	489,526	—	—		661,638	
2	当四半期中の要因別の変動額	リスク量の変動	5,028	77,148	—	—		82,177
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	21,709	△ 22,637	—	—		△ 927
7		その他	△ 2,006	70,127	—	—		68,120
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	196,843	614,165	—	—		811,008
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	3.23	2.74	—	—		2.86	
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	636,989	1,688,273	—	—		2,325,262	