

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6月末 当四半期末:2020年9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	636,989	1,688,273	—	—		2,325,262
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	3.23	2.74	—	—		2.86
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	196,843	614,165	—	—		811,008
2	当四半期中の要因別の変動額	リスク量の変動	231	198,526	—	—	198,758
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	24,943	△ 50,134	—	—	△ 25,190
7		その他	△ 71,248	52,521	—	—	△ 18,727
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	150,769	815,079	—	—	965,849
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	3.67	2.44	—	—	2.63	
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	554,128	1,995,610	—	—	2,549,739	