

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:2022年3月末 当四半期末:2022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	342,252	1,022,659	—	—		1,364,911
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	2.67	3.59	—	—		3.30
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	128,166	284,816	—	—		412,983
2	当四半期中の要因別の変動額	リスク量の変動	82,309	202,531	—	—	284,841
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	3,303	13,548	—	—	16,851
7		その他	△ 8,053	△ 142,747	—	—	△ 150,800
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	205,726	358,149	—	—	563,876
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	2.35	3.16	—	—	2.86	
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	483,942	1,132,795	—	—	1,616,737	