

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6月末 当四半期末:2022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	483,942	1,132,795	—	—		1,616,737
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	2.35	3.16	—	—		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	205,726	358,149	—	—		563,876
2	当四半期中の要因別の変動額	リスク量の変動	△ 92,671	△ 278,586	—	—	△ 371,258
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	15,237	△ 13,716	—	—	1,520
7		その他	△ 13,551	204,719	—	—	191,168
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	114,741	270,566	—	—	385,307
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	5.03	3.62	—	—	4.04	
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	577,730	981,390	—	—	1,559,121	