

## 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: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	1,299,489	3,739,590	—	—		5,039,079
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	2.60	2.85	—	—		2.78
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	499,122	1,311,086	—	—		1,810,209
2	当四半期中の要因別の変動額	リスク量の変動	△ 139,078	△ 380,247	—	—	△ 519,325
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	23,339	21,843	—	—	45,182
7		その他	19,795	206,978	—	—	226,774
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	403,180	1,159,661	—	—	
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	3.55	3.14	—	—		3.24
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	1,431,794	3,641,390	—	—		5,073,185