

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:2023年3月末 当四半期末:2023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	1,316,278	3,929,471	—	—		5,245,750	
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	3.00	2.81	—	—		2.85	
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	437,528	1,396,931	—	—		1,834,460	
2	当四半期中の要因別の変動額	リスク量の変動	458,220	△ 320,743	—	—		137,477
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	△ 17,635	53,366	—	—		35,730
7		その他	△ 441,236	33,160	—	—		△ 408,075
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	436,876	1,162,715	—	—		1,599,592
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	3.20	4.23	—	—		3.94	
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	1,398,193	4,919,450	—	—		6,317,643	