

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:2023年9月末 当四半期末:2023年12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	347,191	1,040,186	—	—		1,387,377
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	2.04	2.69	—	—		2.49
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	169,540	385,867	—	—		555,408
2	当四半期中の要因別の変動額	リスク量の変動	△ 47,937	148,441	—	—	100,504
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	6,584	△ 17,303	—	—	△ 10,719
7		その他	6,139	△ 7,575	—	—	△ 1,435
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	134,328	509,430	—	—	
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	3.12	2.76	—	—		2.84
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	420,230	1,410,495	—	—		1,830,725