

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	1,556,293	5,270,468	—	—		6,826,762
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	3.17	2.67	—	—		2.77
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	490,378	1,967,643	—	—		2,458,022
2	当四半期中の要因別の変動額	リスク量の変動	△ 57,970	△ 795,440	—	—	△ 853,410
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	△ 16,236	△ 48,759	—	—	△ 64,996
7		その他	△ 89,366	△ 26,952	—	—	△ 116,318
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	326,805	1,096,491	—	—	1,423,296
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	4.69	5.31	—	—	5.16	
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	1,533,168	5,823,090	—	—	7,356,259	