

## 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:2018年6月末 当四半期末:2018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・ 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	168,297	506,452	—	—		674,749	
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	2.53	3.29	—	—		3.06	
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	66,500	153,905	—	—		220,405	
2	当四半期中の要因別の変動額	リスク量の変動	437	36,027	—	—		36,464
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	△ 3,681	8,646	—	—		4,964
7		その他	4,049	△ 2,145	—	—		1,903
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	67,304	196,433	—	—		263,738
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	2.99	2.32	—	—		2.49	
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	201,889	456,211	—	—		658,101	