

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9月末 当四半期末:2018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	201,889	456,211	—	—		658,101
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	2.99	2.32	—	—		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	67,304	196,433	—	—		263,738
2	当四半期中の要因別の変動額	リスク量の変動	△ 9,424	△ 3,193	—	—	△ 12,618
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	△ 1,141	△ 440	—	—	△ 1,582
7		その他	706	3,046	—	—	3,752
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	57,445	195,845	—	—	
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	3.08	2.64	—	—		2.74
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	177,400	517,919	—	—		695,319