

## 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:2020年9月末 当四半期末:2020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	365,615	1,364,494	—	—		1,730,110
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	4.33	3.16	—	—		3.35
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	84,372	431,668	—	—		516,040
2	当四半期中の要因別の変動額	リスク量の変動	7,925	△ 54,185	—	—	△ 46,260
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	1,820	△ 7,572	—	—	△ 5,751
7		その他	190	7,428	—	—	7,619
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	94,309	377,339	—	—	
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	3.22	3.17	—	—		3.18
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	303,872	1,198,188	—	—		1,502,060