

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12月末 当四半期末:2021年3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	303,872	1,198,188	—	—		1,502,060	
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	3.22	3.17	—	—		3.18	
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	94,309	377,339	—	—		471,648	
2	当四半期中の要因別の変動額	リスク量の変動	2,775	52,038	—	—		54,813
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	6,923	△ 30,660	—	—		△ 23,737
7		その他	△ 13,570	59,004	—	—		45,434
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	90,436	457,722	—	—		548,159
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	2.73	2.64	—	—		2.65	
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	246,925	1,209,988	—	—		1,456,914	