

## 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:2021年6月末 当四半期末:2021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	424,130	1,512,582	—	—		1,936,712
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	4.30	2.41	—	—		2.67
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	98,532	625,963	—	—		724,495
2	当四半期中の要因別の変動額	リスク量の変動	△ 29,274	△ 264,525	—	—	△ 293,799
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	11,686	△ 41,851	—	—	△ 30,164
7		その他	△ 10,823	45,738	—	—	34,914
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	70,120	365,325	—	—	
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	4.14	3.46	—	—		3.57
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	290,796	1,264,134	—	—		1,554,931