

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9月末 当四半期末:2021年12月末	イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	
		バリュエーション・ アット・ リスク	ストレステスト・ 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	290,796	1,264,134	—	—		1,554,931	
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	4.14	3.46	—	—		3.57	
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	70,120	365,325	—	—		435,445	
2	当四半期中の要因別の変動額	リスク量の変動	22,183	63,189	—	—		85,372
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	△ 730	3,487	—	—		2,757
7		その他	28,168	△ 76,834	—	—		△ 48,666
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	119,742	355,167	—	—		474,910
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	2.88	3.41	—	—		3.28	
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	345,204	1,214,228	—	—		1,559,432	