

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フィナンシャル・グループ)

(単位:百万円)

項番	前四半期末:2018年6月末 当四半期末:2018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	601,367	1,471,173	—	—		2,072,541
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	3.16	3.34	—	—		3.29
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	190,235	439,273	—	—		629,508
2	当四半期中の要因別の変動額	リスク量の変動	16,071	△ 11,749	—	—	4,321
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	△ 4,116	11,169	—	—	7,053
7		その他	5,417	△ 4,601	—	—	816
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	207,608	434,091	—	—	
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	3.01	3.06	—	—		3.05
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	625,764	1,331,954	—	—		1,957,718