

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9月末 当四半期末:2018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	625,764	1,331,954	—	—		1,957,718
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	3.01	3.06	—	—		3.05
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	207,608	434,091	—	—		641,700
2	当四半期中の要因別の変動額	リスク量の変動	△ 2,397	145,587	—	—	143,190
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	4,470	△ 2,527	—	—	1,943
7		その他	△ 4,923	11,043	—	—	6,120
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	204,758	588,195	—	—	
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	3.10	2.67	—	—		2.78
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	635,770	1,572,412	—	—		2,208,183