

## 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12月末 当四半期末:2019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	635,770	1,572,412	—	—		2,208,183
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	3.10	2.67	—	—		2.78
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	204,758	588,195	—	—		792,954
2	当四半期中の要因別の変動額	リスク量の変動	△ 53,972	△ 166,402	—	—	△ 220,374
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	7,653	△ 13,453	—	—	△ 5,800
7		その他	△ 12,175	12,138	—	—	△ 36
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	146,263	420,478	—	—	
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	3.61	3.32	—	—		3.39
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	529,080	1,396,143	—	—		1,925,223