

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:2019年3月末 当四半期末:2019年6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	529,080	1,396,143	—	—		1,925,223	
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	3.61	3.32	—	—		3.39	
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	146,263	420,478	—	—		566,742	
2	当四半期中の要因別の変動額	リスク量の変動	30,660	73,721	—	—		104,382
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	4,491	2,917	—	—		7,408
7		その他	△ 7,662	△ 10,131	—	—		△ 17,793
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	173,753	486,987	—	—		660,740
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	2.67	2.75	—	—		2.73	
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	465,508	1,342,578	—	—		1,808,086	