

## 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9月末 当四半期末:2019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	493,907	1,578,634	—	—		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	3.25	2.91	—	—		2.98
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	151,525	542,286	—	—		693,812
2	当四半期中の要因別の変動額	リスク量の変動	△ 4,713	△ 18,689	—	—	△ 23,403
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	12,861	△ 7,673	—	—	5,187
7		その他	△ 613	34,550	—	—	33,937
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	159,060	550,474	—	—	709,534
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	2.89	2.89	—	—	2.89	
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	460,819	1,595,502	—	—	2,056,321	