

## 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12月末 当四半期末:2020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	460,819	1,595,502	—	—		2,056,321
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	2.89	2.89	—	—		2.89
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	159,060	550,474	—	—		709,534
2	当四半期中の要因別の変動額	リスク量の変動	△ 10,329	△ 35,787	—	—	△ 46,117
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	27,237	△ 38,006	—	—	△ 10,768
7		その他	△ 3,856	12,846	—	—	8,990
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	172,111	489,526	—	—	
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	2.55	3.23	—	—		3.06
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	440,428	1,585,193	—	—		2,025,621