

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:2020年9月末 当四半期末:2020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	554,128	1,995,610	—	—		2,549,739	
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	3.67	2.44	—	—		2.63	
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	150,769	815,079	—	—		965,849	
2	当四半期中の要因別の変動額	リスク量の変動	4,121	△ 127,020	—	—		△ 122,899
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	19,716	△ 7,874	—	—		11,842
7		その他	△ 17,413	△ 44,114	—	—		△ 61,527
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	157,194	636,069	—	—		793,263
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	3.09	3.64	—	—		3.53	
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	487,249	2,316,327	—	—		2,803,577	