

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12月末 当四半期末:2021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	487,249	2,316,327	—	—		2,803,577
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	3.09	3.64	—	—		3.53
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	157,194	636,069	—	—		793,263
2	当四半期中の要因別の変動額	リスク量の変動	△ 6,160	△ 95,937	—	—	△ 102,097
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	11,411	△ 29,858	—	—	△ 18,446
7		その他	△ 1,205	92,749	—	—	91,543
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	161,239	603,023	—	—	
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	3.00	3.55	—	—		3.43
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	484,034	2,144,197	—	—		2,628,232