

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:2021年3月末 当四半期末:2021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	484,034	2,144,197	—	—		2,628,232	
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	3.00	3.55	—	—		3.43	
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	161,239	603,023	—	—		764,262	
2	当四半期中の要因別の変動額	リスク量の変動	28,235	427,713	—	—		455,948
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	10,734	△ 60,865	—	—		△ 50,130
7		その他	△ 23,026	29,263	—	—		6,237
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	177,183	999,135	—	—		1,176,318
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	3.65	2.44	—	—		2.63	
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	648,377	2,447,672	—	—		3,096,050	