

## 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6月末 当四半期末:2021年9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	648,377	2,447,672	—	—		3,096,050
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	3.65	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	177,183	999,135	—	—		1,176,318
2	当四半期中の要因別の変動額	リスク量の変動	△ 17,172	△ 221,501	—	—	△ 238,674
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	17,054	△ 52,898	—	—	△ 35,843
7		その他	△ 18,613	85,721	—	—	67,108
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	158,451	810,456	—	—	
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	3.34	2.79	—	—		2.88
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	529,430	2,261,206	—	—		2,790,637