

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9月末 当四半期末:2021年12月末	イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	
		バリュエーション・ アット・ リスク	ストレステスト・ 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	529,430	2,261,206	—	—		2,790,637	
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	3.34	2.79	—	—		2.88	
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	158,451	810,456	—	—		968,908	
2	当四半期中の要因別の変動額	リスク量の変動	67,126	144,156	—	—		211,282
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	20,268	△ 14,234	—	—		6,033
7		その他	△ 8,735	△ 35,524	—	—		△ 44,260
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	237,110	904,854	—	—		1,141,964
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	2.74	2.77	—	—		2.77	
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	652,008	2,514,036	—	—		3,166,045	