

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12月末 当四半期末:2022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	652,008	2,514,036	—	—		3,166,045	
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	2.74	2.77	—	—		2.77	
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	237,110	904,854	—	—		1,141,964	
2	当四半期中の要因別の変動額	リスク量の変動	105,013	132,518	—	—		237,532
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	△ 9,147	59,725	—	—		50,578
7		その他	35,024	△ 46,624	—	—		△ 11,600
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	368,001	1,050,473	—	—		1,418,474
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	2.19	2.29	—	—		2.27	
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	807,291	2,415,150	—	—		3,222,441	