

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銀行・連結)

(単位:百万円)

項番	前四半期末:2019年6月末 当四半期末:2019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	335,679	962,590	—	—		1,298,270
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	2.60	2.61	—	—		2.61
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	128,936	367,891	—	—		496,827
2	当四半期中の要因別の変動額	リスク量の変動	△ 15,288	△ 23,514	—	—	△ 38,802
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	933	△ 8,326	—	—	△ 7,393
7		その他	△ 11,895	54,284	—	—	42,388
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	102,685	390,335	—	—	
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	3.48	2.79	—	—		2.93
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	358,289	1,090,387	—	—		1,448,676