

(単位:百万円)

| OV1:リスク・アセットの概要(三菱UFJフィナンシャル・グループ) | | | | | |
|------------------------------------|--|-------------|-------------|------------|------------|
| 国際様式の 該当番号 | | イ | ロ | ハ | ニ |
| | | リスク・アセット | | 所要自己資本 | |
| | | 2022年12月末 | 2022年9月末 | 2022年12月末 | 2022年9月末 |
| 1 | 信用リスク | 70,236,370 | 72,067,715 | 5,815,531 | 5,956,328 |
| 2 | うち、標準的手法適用分 | 23,942,229 | 27,286,342 | 1,915,378 | 2,182,907 |
| 3 | うち、内部格付手法適用分 | 40,962,811 | 39,773,274 | 3,473,646 | 3,372,773 |
| | うち、重要な出資のエクスポージャー | - | - | - | - |
| | うち、リース取引における見積残存価額のエクスポージャー | 9 | 9 | 0 | 0 |
| | その他 | 5,331,319 | 5,008,088 | 426,505 | 400,647 |
| 4 | カウンターパーティ信用リスク | 7,759,708 | 9,161,116 | 627,705 | 741,928 |
| 5 | うち、SA-CCR適用分 | - | - | - | - |
| | うち、カレント・エクスポージャー方式適用分 | 2,502,050 | 2,782,836 | 204,703 | 228,656 |
| 6 | うち、期待エクスポージャー方式適用分 | - | - | - | - |
| | うち、CVAリスク | 3,200,996 | 3,637,378 | 256,079 | 290,990 |
| | うち、中央清算機関関連エクスポージャー | 654,104 | 715,930 | 52,328 | 57,274 |
| | その他 | 1,402,556 | 2,024,971 | 114,594 | 165,008 |
| 7 | マーケット・ベース方式に基づく株式等エクスポージャー | 2,026,856 | 2,018,478 | 171,877 | 171,166 |
| 8 | リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算 (ルック・スルー方式) | 3,941,290 | 4,094,373 | 331,089 | 343,987 |
| 9 | リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算 (マニフェスト方式) | 1,907,691 | 1,853,721 | 154,235 | 149,587 |
| | リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算 (蓋然性方式250%) | - | - | - | - |
| | リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算 (蓋然性方式400%) | 109,701 | 122,635 | 9,214 | 10,269 |
| 10 | リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算 (フォールバック方式1250%) | 122,155 | 112,762 | 9,772 | 9,020 |
| 11 | 未決済取引 | 20,415 | 87,225 | 1,730 | 7,396 |
| 12 | 信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャー | 2,461,180 | 2,511,433 | 196,894 | 200,914 |
| 13 | うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分 | 656,161 | 678,485 | 52,492 | 54,278 |
| 14 | うち、外部格付準拠方式適用分 | 1,173,049 | 1,245,737 | 93,843 | 99,659 |
| 15 | うち、標準的手法準拠方式適用分 | 524,905 | 480,170 | 41,992 | 38,413 |
| | うち、1250%のリスク・ウェイト適用分 | 107,064 | 107,040 | 8,565 | 8,563 |
| 16 | マーケット・リスク | 5,040,499 | 6,308,728 | 403,239 | 504,698 |
| 17 | うち、標準的方式適用分 | 1,057,387 | 1,235,543 | 84,590 | 98,843 |
| 18 | うち、内部モデル方式適用分 | 3,983,112 | 5,073,185 | 318,649 | 405,854 |
| 19 | オペレーショナル・リスク | 8,259,792 | 7,989,640 | 660,783 | 639,171 |
| 20 | うち、基礎的手法適用分 | 3,185,057 | 3,185,057 | 254,804 | 254,804 |
| 21 | うち、粗利益配分手法適用分 | - | - | - | - |
| 22 | うち、先進的計測手法適用分 | 5,074,735 | 4,804,582 | 405,978 | 384,366 |
| 23 | 特定項目のうち、調整項目に算入されない部分に係るエクスポージャー | 4,803,913 | 4,869,877 | 407,371 | 412,965 |
| | 経過措置によりリスク・アセットの額に算入されるものの額 | - | - | - | - |
| 24 | フロア調整 | 19,000,613 | 17,816,398 | 1,520,049 | 1,425,311 |
| 25 | 合計(スケールリングファクター勘案後) | 128,868,704 | 132,159,354 | 10,309,496 | 10,572,748 |