

(単位:百万円)

OV1:リスク・アセットの概要(三菱UFJ銀行・連結)					
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	
		2021年9月末	2021年6月末	2021年9月末	2021年6月末
1	信用リスク	58,742,494	59,101,631	4,868,671	4,897,504
2	うち、標準的手法適用分	20,571,880	20,805,791	1,645,750	1,664,463
3	うち、内部格付手法適用分	35,264,978	35,286,274	2,990,470	2,992,276
	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	-	-	-	-
	その他	2,905,635	3,009,565	232,450	240,765
4	カウンターパーティ信用リスク	5,949,935	6,209,927	481,520	502,569
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	1,367,786	1,407,558	113,994	117,457
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	3,169,027	3,349,130	253,522	267,930
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	402,684	406,246	32,214	32,499
	その他	1,010,437	1,046,990	81,788	84,680
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	1,401,389	1,487,927	118,837	126,176
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)	2,956,521	2,415,665	248,514	202,985
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(マンドート方式)	85,060	69,718	7,174	5,909
	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%)	32,274	9,778	2,736	829
	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%)	24,851	18,630	1,988	1,490
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%)	26,264	29,156	2,101	2,332
11	未決済取引	12,448	14,286	1,055	1,211
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	1,470,038	1,479,033	117,603	118,322
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	424,314	408,404	33,945	32,672
14	うち、外部格付準拠方式適用分	590,543	607,082	47,243	48,566
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	333,682	335,597	26,694	26,847
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	121,497	127,949	9,719	10,235
16	マーケット・リスク	2,092,303	2,502,898	167,384	200,231
17	うち、標準的方式適用分	537,372	566,185	42,989	45,294
18	うち、内部モデル方式適用分	1,554,931	1,936,712	124,394	154,937
19	オペレーショナル・リスク	5,354,195	5,395,383	428,336	431,630
20	うち、基礎的手法適用分	2,371,385	2,391,385	189,711	191,310
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	2,982,810	3,003,998	238,625	240,319
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	1,434,340	1,500,091	121,632	127,207
	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	12,219,662	11,281,603	977,572	902,528
25	合計(スケーリングファクター勘案後)	94,314,105	94,011,623	7,545,128	7,520,929