

(単位:百万円)

OV1:リスク・アセットの概要(三菱UFJ銀行・単体)					
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	46,397,756	46,532,696	3,928,436	3,939,800
2	うち、標準的手法適用分	-	-	-	-
3	うち、内部格付手法適用分	45,128,312	45,246,835	3,826,880	3,836,931
	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	1,269,443	1,285,860	101,555	102,868
4	カウンターパーティ信用リスク	4,823,161	5,124,823	393,517	418,141
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	960,038	1,018,039	81,411	86,329
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	2,924,667	3,126,098	233,973	250,087
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	301,692	299,650	24,135	23,972
	その他	636,762	681,035	53,997	57,751
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	18,350	20,986	1,556	1,779
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)	3,027,743	2,498,891	254,853	210,301
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(マナド方式)	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%)	20	26	1	2
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%)	2,595	4,212	207	337
11	未決済取引	12,448	14,284	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	1,242,161	1,238,433	99,372	99,074
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	393,910	402,920	31,512	32,233
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	317,175	320,368	25,374	25,629
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	106,761	106,740	8,540	8,539
16	マーケット・リスク	816,411	1,169,974	65,312	93,597
17	うち、標準的方式適用分	72,984	90,663	5,838	7,253
18	うち、内部モデル方式適用分	743,427	1,079,310	59,474	86,344
19	オペレーショナル・リスク	3,000,209	3,029,754	240,017	242,380
20	うち、基礎的手法適用分	19,945	30,061	1,596	2,404
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	2,980,264	2,999,692	238,421	239,975
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	587,181	574,603	49,793	48,726
	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	17,471,438	16,984,818	1,397,715	1,358,785
25	合計(スケーリングファクター勘案後)	80,521,874	80,260,969	6,441,749	6,420,877