

(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	
		2021年3月末	2020年12月末	2021年3月末	2020年12月末
1	信用リスク	64,951,304	64,786,499	5,382,818	5,369,305
2	うち、標準的手法適用分	22,066,739	21,904,125	1,765,339	1,752,330
3	うち、内部格付手法適用分	38,898,812	38,830,420	3,298,619	3,292,819
	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	3,985,743	4,051,944	318,859	324,155
4	カウンターパーティ信用リスク	9,012,347	9,304,379	727,403	750,914
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	2,493,125	2,588,203	204,535	212,156
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	3,994,525	4,447,145	319,562	355,771
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	688,254	736,926	55,060	58,954
	その他	1,836,442	1,532,103	148,245	124,032
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	1,701,877	1,711,421	144,319	145,128
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)	4,296,484	3,877,312	362,324	326,221
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(マナドット方式)	1,018,048	913,903	81,834	73,519
	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%)	79,515	87,515	6,724	7,407
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%)	64,727	74,762	5,178	5,980
11	未決済取引	2,451	8,533	207	723
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	2,112,474	2,217,264	168,997	177,381
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	431,843	516,344	34,547	41,307
14	うち、外部格付準拠方式適用分	1,177,993	1,194,609	94,239	95,568
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	375,740	376,877	30,059	30,150
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	126,896	129,433	10,151	10,354
16	マーケット・リスク	4,066,808	4,027,977	325,344	322,238
17	うち、標準的方式適用分	1,438,576	1,224,400	115,086	97,952
18	うち、内部モデル方式適用分	2,628,232	2,803,577	210,258	224,286
19	オペレーショナル・リスク	7,976,657	8,543,494	638,132	683,479
20	うち、基礎的手法適用分	3,140,996	3,206,452	251,279	256,516
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	4,835,661	5,337,041	386,852	426,963
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	4,162,644	4,179,629	352,992	354,432
	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	11,965,885	11,198,474	957,270	895,877
25	合計(スケールリングファクター勘案後)	114,419,369	113,907,647	9,153,549	9,112,611