

(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6月末	2021年3月末	2021年6月末	2021年3月末
1	信用リスク	65,285,462	64,951,304	5,405,914	5,382,818
2	うち、標準的手法適用分	23,039,525	22,066,739	1,843,162	1,765,339
3	うち、内部格付手法適用分	38,141,121	38,898,812	3,234,367	3,298,619
	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	4,104,806	3,985,743	328,384	318,859
4	カウンターパーティ信用リスク	8,564,942	9,012,347	691,033	727,403
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	2,281,880	2,493,125	187,213	204,535
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	3,693,158	3,994,525	295,452	319,562
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	688,211	688,254	55,056	55,060
	その他	1,901,692	1,836,442	153,310	148,245
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	1,778,727	1,701,877	150,836	144,319
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)	4,352,948	4,296,484	365,661	362,324
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)	1,070,643	1,018,048	85,986	81,834
	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%)	95,193	79,515	7,983	6,724
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%)	64,153	64,727	5,132	5,178
11	未決済取引	14,288	2,451	1,211	207
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	2,039,014	2,112,474	163,121	168,997
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	408,404	431,843	32,672	34,547
14	うち、外部格付準拠方式適用分	1,166,875	1,177,993	93,350	94,239
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	335,597	375,740	26,847	30,059
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	128,137	126,896	10,250	10,151
16	マーケット・リスク	4,355,237	4,066,808	348,419	325,344
17	うち、標準的方式適用分	1,259,187	1,438,576	100,735	115,086
18	うち、内部モデル方式適用分	3,096,050	2,628,232	247,684	210,258
19	オペレーショナル・リスク	7,984,943	7,976,657	638,795	638,132
20	うち、基礎的手法適用分	3,140,996	3,140,996	251,279	251,279
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	4,843,947	4,835,661	387,515	386,852
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	4,415,673	4,162,644	374,449	352,992
	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	8,217,645	11,965,885	657,411	957,270
25	合計(スケールリングファクター勘案後)	111,199,436	114,419,369	8,895,954	9,153,549