

(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9月末	2021年6月末	2021年9月末	2021年6月末
1	信用リスク	64,984,026	65,285,462	5,382,501	5,405,914
2	うち、標準的手法適用分	22,683,715	23,039,525	1,814,697	1,843,162
3	うち、内部格付手法適用分	38,287,461	38,141,121	3,246,776	3,234,367
	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	4,012,839	4,104,806	321,027	328,384
4	カウンターパーティ信用リスク	8,562,611	8,564,942	690,783	691,033
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	2,280,258	2,281,880	186,849	187,213
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	3,734,317	3,693,158	298,745	295,452
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	674,634	688,211	53,970	55,056
	その他	1,873,400	1,901,692	151,217	153,310
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	1,702,592	1,778,727	144,379	150,836
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)	4,871,175	4,352,948	409,043	365,661
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)	1,153,693	1,070,643	92,626	85,986
	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%)	101,385	95,193	8,478	7,983
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%)	65,300	64,153	5,224	5,132
11	未決済取引	12,450	14,288	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	2,059,756	2,039,014	164,780	163,121
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	1,180,074	1,166,875	94,405	93,350
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	121,684	128,137	9,734	10,250
16	マーケット・リスク	4,280,867	4,355,237	342,469	348,419
17	うち、標準的方式適用分	1,490,230	1,259,187	119,218	100,735
18	うち、内部モデル方式適用分	2,790,637	3,096,050	223,250	247,684
19	オペレーショナル・リスク	7,888,838	7,984,943	631,107	638,795
20	うち、基礎的手法適用分	3,094,690	3,140,996	247,575	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	4,794,148	4,843,947	383,531	387,515
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	4,444,993	4,415,673	376,935	374,449
	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	9,074,443	8,217,645	725,955	657,411
25	合計(スケールリングファクター勘案後)	112,191,761	111,199,436	8,975,340	8,895,954