

(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3月末	2020年12月末	2021年3月末	2020年12月末
1	信用リスク	59,363,896	58,851,662	4,923,202	4,880,709
2	うち、標準的手法適用分	19,924,053	19,789,587	1,593,924	1,583,167
3	うち、内部格付手法適用分	36,268,980	35,953,346	3,075,609	3,048,843
	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	3,170,862	3,108,728	253,669	248,698
4	カウンターパーティ信用リスク	6,181,707	6,888,945	500,515	557,628
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	1,483,063	1,611,322	123,696	134,248
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	3,397,508	4,052,341	271,800	324,187
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	384,753	431,357	30,780	34,508
	その他	916,381	793,923	74,237	64,684
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	1,424,710	1,449,068	120,815	122,881
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)	2,384,150	2,484,907	201,827	209,689
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)	81,455	85,886	6,904	7,277
	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%)	9,938	11,101	842	941
	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%)	3,763	2,865	301	229
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%)	26,892	23,224	2,151	1,857
11	未決済取引	2,451	8,524	207	722
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	1,562,641	1,676,418	125,011	134,113
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	628,348	653,950	50,267	52,316
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	126,709	129,245	10,136	10,339
16	マーケット・リスク	2,015,425	2,065,967	161,234	165,277
17	うち、標準的方式適用分	558,511	563,907	44,680	45,112
18	うち、内部モデル方式適用分	1,456,914	1,502,060	116,553	120,164
19	オペレーショナル・リスク	5,392,807	5,451,008	431,424	436,080
20	うち、基礎的手法適用分	2,391,385	2,447,549	191,310	195,803
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	3,001,422	3,003,458	240,113	240,276
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	1,372,027	1,345,185	116,347	114,071
	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	14,854,511	13,782,396	1,188,360	1,102,591
25	合計(スケーリングファクター勘案後)	97,239,338	96,675,913	7,779,147	7,734,073