

(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6月末	2021年3月末	2021年6月末	2021年3月末
1	信用リスク	59,101,631	59,363,896	4,897,504	4,923,202
2	うち、標準的手法適用分	20,805,791	19,924,053	1,664,463	1,593,924
3	うち、内部格付手法適用分	35,286,274	36,268,980	2,992,276	3,075,609
	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	3,009,565	3,170,862	240,765	253,669
4	カウンターパーティ信用リスク	6,209,927	6,181,707	502,569	500,515
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	1,407,558	1,483,063	117,457	123,696
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	3,349,130	3,397,508	267,930	271,800
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	406,246	384,753	32,499	30,780
	その他	1,046,990	916,381	84,680	74,237
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	1,487,927	1,424,710	126,176	120,815
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)	2,415,665	2,384,150	202,985	201,827
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 (マナデート方式)	69,718	81,455	5,909	6,904
	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%)	9,778	9,938	829	842
	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%)	18,630	3,763	1,490	301
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%)	29,156	26,892	2,332	2,151
11	未決済取引	14,286	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	1,479,033	1,562,641	118,322	125,011
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	607,082	628,348	48,566	50,267
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	127,949	126,709	10,235	10,136
16	マーケット・リスク	2,502,898	2,015,425	200,231	161,234
17	うち、標準的方式適用分	566,185	558,511	45,294	44,680
18	うち、内部モデル方式適用分	1,936,712	1,456,914	154,937	116,553
19	オペレーショナル・リスク	5,395,383	5,392,807	431,630	431,424
20	うち、基礎的手法適用分	2,391,385	2,391,385	191,310	191,310
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	3,003,998	3,001,422	240,319	240,113
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	1,500,091	1,372,027	127,207	116,347
	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	11,281,603	14,854,511	902,528	1,188,360
25	合計(スケーリングファクター勘案後)	94,011,623	97,239,338	7,520,929	7,779,147