

(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<br>該当番号                      |  | イ           | ロ           | ハ         | ニ         |
|                                    |  | リスク・アセット    |             | 所要自己資本    |           |
|                                    |  | 2021年12月末   | 2021年9月末    | 2021年12月末 | 2021年9月末  |
| 1                                  | 信用リスク  | 66,109,679  | 64,984,026  | 5,474,228 | 5,382,501 |
| 2                                  | うち、標準的手法適用分  | 23,385,929  | 22,683,715  | 1,870,874 | 1,814,697 |
| 3                                  | うち、内部格付手法適用分   | 38,636,267  | 38,287,461  | 3,276,355 | 3,246,776 |
|                                    | 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  | 4,087,473   | 4,012,839   | 326,997   | 321,027   |
| 4                                  | カウンターパーティ信用リスク                                       | 8,062,931   | 8,562,611   | 651,261   | 690,783   |
| 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                                | 2,242,395   | 2,280,258   | 183,754   | 186,849   |
| 6                                  | うち、期待エクスポージャー方式適用分                                   | -           | -           | -         | -         |
|                                    | うち、CVAリスク  | 3,582,890   | 3,734,317   | 286,631   | 298,745   |
|                                    | うち、中央清算機関関連エクスポージャー                                  | 631,829     | 674,634     | 50,546    | 53,970    |
|                                    | その他  | 1,605,815   | 1,873,400   | 130,329   | 151,217   |
| 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                           | 1,705,935   | 1,702,592   | 144,663   | 144,379   |
| 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<br>(ルック・スルー方式)      | 4,863,691   | 4,871,175   | 409,180   | 409,043   |
| 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<br>(マナドット方式)        | 1,265,001   | 1,153,693   | 101,597   | 92,626    |
|                                    | 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<br>(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<br>(蓋然性方式400%)      | 115,270     | 101,385     | 9,658     | 8,478     |
| 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<br>(フォールバック方式1250%) | 66,244      | 65,300      | 5,299     | 5,224     |
| 11                                 | 未決済取引  | 6,260       | 12,450      | 530       | 1,055     |
| 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                   | 1,947,338   | 2,059,756   | 155,787   | 164,780   |
| 13                                 | うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分                             | 434,974     | 424,314     | 34,797    | 33,945    |
| 14                                 | うち、外部格付準拠方式適用分                                       | 1,037,682   | 1,180,074   | 83,014    | 94,405    |
| 15                                 | うち、標準的手法準拠方式適用分                                      | 353,181     | 333,682     | 28,254    | 26,694    |
|                                    | うち、1250%のリスク・ウェイト適用分                                 | 121,500     | 121,684     | 9,720     | 9,734     |
| 16                                 | マーケット・リスク  | 4,344,191   | 4,280,867   | 347,535   | 342,469   |
| 17                                 | うち、標準的方式適用分  | 1,178,146   | 1,490,230   | 94,251    | 119,218   |
| 18                                 | うち、内部モデル方式適用分  | 3,166,045   | 2,790,637   | 253,283   | 223,250   |
| 19                                 | オペレーショナル・リスク   | 7,949,473   | 7,888,838   | 635,957   | 631,107   |
| 20                                 | うち、基礎的手法適用分  | 3,094,690   | 3,094,690   | 247,575   | 247,575   |
| 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  | 4,854,783   | 4,794,148   | 388,382   | 383,531   |
| 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                     | 4,449,057   | 4,444,993   | 377,280   | 376,935   |
|                                    | 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  | 13,204,444  | 9,074,443   | 1,056,355 | 725,955   |
| 25                                 | 合計(スケールリングファクター勘案後)                                  | 117,116,709 | 112,191,761 | 9,369,336 | 8,975,340 |