

(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 (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 (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 (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%)	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 (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