

(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	
		2022年3月末	2021年12月末	2022年3月末	2021年12月末
1	信用リスク	66,790,325	66,109,679	5,529,674	5,474,228
2	うち、標準的手法適用分	23,955,270	23,385,929	1,916,421	1,870,874
3	うち、内部格付手法適用分	38,843,344	38,636,267	3,293,915	3,276,355
	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	3,991,701	4,087,473	319,336	326,997
4	カウンターパーティ信用リスク	8,337,029	8,062,931	674,423	651,261
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	2,451,883	2,242,395	201,403	183,754
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	3,495,478	3,582,890	279,638	286,631
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	629,576	631,829	50,366	50,546
	その他	1,760,090	1,605,815	143,016	130,329
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	1,673,593	1,705,935	141,920	144,663
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)	3,806,817	4,863,691	318,618	409,180
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)	1,419,460	1,265,001	113,891	101,597
	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%)	124,772	115,270	10,460	9,658
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%)	92,217	66,244	7,377	5,299
11	未決済取引	3,307	6,260	272	530
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	2,026,276	1,947,338	162,102	155,787
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	529,733	434,974	42,378	34,797
14	うち、外部格付準拠方式適用分	1,072,768	1,037,682	85,821	83,014
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	302,056	353,181	24,164	28,254
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	121,717	121,500	9,737	9,720
16	マーケット・リスク	4,389,929	4,344,191	351,194	347,535
17	うち、標準的方式適用分	1,167,487	1,178,146	93,398	94,251
18	うち、内部モデル方式適用分	3,222,441	3,166,045	257,795	253,283
19	オペレーショナル・リスク	7,990,173	7,949,473	639,213	635,957
20	うち、基礎的手法適用分	3,124,166	3,094,690	249,933	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	4,866,007	4,854,783	389,280	388,382
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	4,663,176	4,449,057	395,437	377,280
	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	20,606,911	13,204,444	1,648,552	1,056,355
25	合計(スケールリングファクター勘案後)	124,914,250	117,116,709	9,993,140	9,369,336