

(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	
		2020年12月末	2020年9月末	2020年12月末	2020年9月末
1	信用リスク	58,851,662	58,736,644	4,880,709	4,867,000
2	うち、標準的手法適用分	19,789,587	20,430,468	1,583,167	1,634,437
3	うち、内部格付手法適用分	35,953,346	35,014,420	3,048,843	2,969,222
	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	3,108,728	3,291,754	248,698	263,340
4	カウンターパーティ信用リスク	6,888,945	7,421,753	557,628	601,268
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	1,611,322	1,648,855	134,248	137,414
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	4,052,341	4,321,005	324,187	345,680
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	431,357	466,639	34,508	37,331
	その他	793,923	985,253	64,684	80,841
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	1,449,068	1,522,182	122,881	129,081
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)	2,484,907	1,693,756	209,689	139,331
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)	85,886	81,647	7,277	8,652
	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%)	11,101	-	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%)	2,865	3,154	229	252
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%)	23,224	15,697	1,857	1,255
11	未決済取引	8,524	15,913	722	1,349
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	1,676,418	1,731,434	134,113	138,514
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	516,344	565,886	41,307	45,270
14	うち、外部格付準拠方式適用分	653,950	667,533	52,316	53,402
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	376,877	368,880	30,150	29,510
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	129,245	129,134	10,339	10,330
16	マーケット・リスク	2,065,967	2,175,001	165,277	174,000
17	うち、標準的方式適用分	563,907	444,891	45,112	35,591
18	うち、内部モデル方式適用分	1,502,060	1,730,110	120,164	138,408
19	オペレーショナル・リスク	5,451,008	5,433,060	436,080	434,644
20	うち、基礎的手法適用分	2,447,549	2,447,549	195,803	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	3,003,458	2,985,510	240,276	238,840
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	1,345,185	1,336,808	114,071	113,361
	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	13,782,396	13,960,026	1,102,591	1,116,802
25	合計(スケーリングファクター勘案後)	96,675,913	96,568,947	7,734,073	7,725,515