

(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	
		2019年3月末	2018年12月末	2019年3月末	2018年12月末
1	信用リスク	65,897,294	65,658,830	5,469,294	5,447,713
2	うち、標準的手法適用分	20,207,111	20,683,715	1,616,568	1,654,697
3	うち、内部格付手法適用分	41,148,081	40,626,484	3,489,357	3,445,125
	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	10	21	0	1
	その他	4,542,091	4,348,609	363,367	347,888
4	カウンターパーティ信用リスク	8,558,362	8,746,769	691,485	707,079
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	2,441,895	2,542,883	200,675	208,825
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	4,097,836	4,036,526	327,826	322,922
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	715,377	756,716	57,230	60,537
	その他	1,303,253	1,410,643	105,752	114,794
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	1,847,288	1,877,604	156,650	159,220
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)	3,631,920		301,081	
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)	634,862		51,017	
	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%)	16,341		1,307	
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%)	64,763		5,181	
	複数の資産及び取引を裏付けとするエクスポージャー		-		-
	信用リスク・アセットのみなし計算が適用されるエクスポージャー		3,737,178		316,912
11	未決済取引	82,264	6,037	6,975	511
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	3,181,220	2,292,061	254,497	190,543
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	666,059		53,284	
14	うち、外部格付準拠方式適用分	1,496,760		119,740	
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	886,176		70,894	
	うち、内部格付手法における外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分		481,744		40,851
	うち、内部格付手法における指定関数方式適用分		906,995		76,913
	うち、標準的手法適用分		404,783		32,382
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	132,224	498,537	10,577	40,395
16	マーケット・リスク	2,920,576	3,200,820	233,646	256,065
17	うち、標準的方式適用分	995,352	992,637	79,628	79,410
18	うち、内部モデル方式適用分	1,925,223	2,208,183	154,017	176,654
19	オペレーショナル・リスク	8,107,263	7,375,886	648,581	590,070
20	うち、基礎的手法適用分	2,627,394	2,461,633	210,191	196,930
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	5,479,869	4,914,253	438,389	393,140
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	3,890,974	3,320,457	329,954	281,574
	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	15,220,209	17,736,776	1,217,616	1,418,942
25	合計(スケーリングファクター勘案後)	117,091,124	117,107,939	9,367,289	9,368,635