

(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	
		2020年9月末	2020年6月末	2020年9月末	2020年6月末
1	信用リスク	64,480,889	65,211,289	5,340,113	5,400,855
2	うち、標準的手法適用分	22,457,916	21,971,981	1,796,633	1,757,758
3	うち、内部格付手法適用分	37,842,227	38,323,433	3,209,020	3,249,827
	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	4,180,736	4,915,865	334,458	393,269
4	カウンターパーティ信用リスク	9,773,829	9,913,228	789,502	800,453
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	2,649,093	2,798,240	217,149	229,221
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	4,632,565	4,664,824	370,605	373,185
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	771,062	741,855	61,684	59,348
	その他	1,721,108	1,708,307	140,063	138,698
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	1,768,212	1,808,338	149,944	153,347
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)	3,139,488	3,127,093	260,521	262,115
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)	816,011	783,905	67,401	63,064
	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%)	41,665	41,675	3,518	3,521
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%)	71,217	63,696	5,697	5,095
11	未決済取引	15,914	18,720	1,349	1,586
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	2,286,814	2,399,833	182,945	191,986
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	565,886	674,999	45,270	53,999
14	うち、外部格付準拠方式適用分	1,222,726	1,201,821	97,818	96,145
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	368,880	393,950	29,510	31,516
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	129,321	129,062	10,345	10,324
16	マーケット・リスク	3,460,659	3,236,849	276,852	258,947
17	うち、標準的方式適用分	910,920	911,586	72,873	72,926
18	うち、内部モデル方式適用分	2,549,739	2,325,262	203,979	186,021
19	オペレーショナル・リスク	8,163,895	8,248,764	653,111	659,901
20	うち、基礎的手法適用分	3,206,452	3,217,023	256,516	257,361
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	4,957,442	5,031,740	396,595	402,539
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	4,100,585	4,039,343	347,729	342,536
	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	12,328,946	13,599,719	986,315	1,087,977
25	合計(スケールリングファクター勘案後)	113,312,548	115,392,381	9,065,003	9,231,390