

(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9月末	2020年6月末	2020年9月末	2020年6月末
1	信用リスク	58,736,644	59,469,193	4,867,000	4,929,083
2	うち、標準的手法適用分	20,430,468	19,926,933	1,634,437	1,594,154
3	うち、内部格付手法適用分	35,014,420	35,739,213	2,969,222	3,030,685
	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	3,291,754	3,803,046	263,340	304,243
4	カウンターパーティ信用リスク	7,421,753	7,480,621	601,268	605,892
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	1,648,855	1,757,781	137,414	146,439
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	4,321,005	4,338,110	345,680	347,048
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	466,639	448,867	37,331	35,909
	その他	985,253	935,863	80,841	76,494
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	1,522,182	1,559,418	129,081	132,238
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)	1,693,756	1,965,021	139,331	164,839
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)	81,647	73,923	8,652	6,266
	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%)	3,154	2,624	252	210
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%)	15,697	7,850	1,255	628
11	未決済取引	15,913	18,545	1,349	1,572
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	1,731,434	1,857,659	138,514	148,612
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	667,533	659,835	53,402	52,786
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	129,134	128,874	10,330	10,309
16	マーケット・リスク	2,175,001	1,866,552	174,000	149,324
17	うち、標準的方式適用分	444,891	424,903	35,591	33,992
18	うち、内部モデル方式適用分	1,730,110	1,441,649	138,408	115,331
19	オペレーショナル・リスク	5,433,060	5,422,854	434,644	433,828
20	うち、基礎的手法適用分	2,447,549	2,429,228	195,803	194,338
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	2,985,510	2,993,625	238,840	239,490
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	1,336,808	1,282,854	113,361	108,786
	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	13,960,026	16,046,974	1,116,802	1,283,757
25	合計(スケーリングファクター勘案後)	96,568,947	99,563,004	7,725,515	7,965,040