

(単位:百万円)

OV1:リスク・アセットの概要(三菱UFJ銀行・単体)					
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	47,287,360	46,440,658	4,003,630	3,931,489
2	うち、標準的手法適用分	-	-	-	-
3	うち、内部格付手法適用分	45,967,090	45,049,418	3,898,009	3,820,190
	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	1,320,270	1,391,240	105,621	111,299
4	カウンターパーティ信用リスク	5,788,811	6,254,605	471,528	509,716
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	1,121,855	1,155,460	95,133	97,983
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	3,698,534	3,940,192	295,882	315,215
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	335,285	366,827	26,822	29,346
	その他	633,136	792,125	53,689	67,172
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	19,266	16,944	1,633	1,436
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)	2,549,264	1,705,610	215,376	140,804
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%)	38	46	3	3
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%)	4,706	2,903	376	232
11	未決済取引	8,579	15,905	727	1,348
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	1,440,785	1,496,576	115,262	119,726
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	461,463	476,358	36,917	38,108
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	356,278	347,653	28,502	27,812
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	106,698	106,678	8,535	8,534
16	マーケット・リスク	981,352	1,266,722	78,508	101,337
17	うち、標準的方式適用分	71,116	77,375	5,689	6,190
18	うち、内部モデル方式適用分	910,235	1,189,346	72,818	95,147
19	オペレーショナル・リスク	3,027,756	3,010,439	242,220	240,835
20	うち、基礎的手法適用分	27,803	27,803	2,224	2,224
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	2,999,952	2,982,635	239,996	238,610
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	606,849	602,038	51,460	51,052
	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	16,859,476	17,222,397	1,348,758	1,377,791
25	合計(スケーリングファクター勘案後)	81,721,343	81,055,369	6,537,707	6,484,429