

(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6月末	2019年3月末	2019年6月末	2019年3月末
1	信用リスク	66,221,508	65,897,294	5,488,141	5,469,294
2	うち、標準的手法適用分	21,765,258	20,207,111	1,741,220	1,616,568
3	うち、内部格付手法適用分	39,671,084	41,148,081	3,364,107	3,489,357
	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	10	0	0
	その他	4,785,154	4,542,091	382,812	363,367
4	カウンターパーティ信用リスク	8,769,429	8,558,362	709,036	691,485
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	2,530,690	2,441,895	208,094	200,675
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	4,118,833	4,097,836	329,506	327,826
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	677,074	715,377	54,165	57,230
	その他	1,442,830	1,303,253	117,268	105,752
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	1,978,607	1,847,288	167,785	156,650
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)	3,883,734	3,631,920	320,478	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)	698,856	634,862	56,187	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%)	16,031	16,341	1,282	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%)	62,398	64,763	4,991	5,181
11	未決済取引	11,972	82,264	1,014	6,975
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	2,906,011	3,181,220	232,480	254,497
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	817,081	666,059	65,366	53,284
14	うち、外部格付準拠方式適用分	1,414,815	1,496,760	113,185	119,740
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	541,024	886,176	43,281	70,894
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	133,090	132,224	10,647	10,577
16	マーケット・リスク	2,685,828	2,920,576	214,866	233,646
17	うち、標準的方式適用分	877,741	995,352	70,219	79,628
18	うち、内部モデル方式適用分	1,808,086	1,925,223	144,646	154,017
19	オペレーショナル・リスク	7,958,462	8,107,263	636,676	648,581
20	うち、基礎的手法適用分	2,627,394	2,627,394	210,191	210,191
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	5,331,067	5,479,869	426,485	438,389
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	3,775,064	3,890,974	320,125	329,954
	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	13,320,233	15,220,209	1,065,618	1,217,616
25	合計(スケーリングファクター勘案後)	115,233,589	117,091,124	9,218,687	9,367,289