

(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12月末	2019年9月末	2019年12月末	2019年9月末
1	信用リスク	64,009,761	63,232,609	5,300,612	5,235,981
2	うち、標準的手法適用分	21,903,203	21,779,711	1,752,256	1,742,376
3	うち、内部格付手法適用分	37,464,927	36,952,630	3,177,025	3,133,583
	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	4,641,621	4,500,257	371,329	360,020
4	カウンターパーティ信用リスク	8,368,309	8,920,936	675,575	719,903
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	2,447,884	2,453,911	200,300	201,348
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	3,843,682	4,349,752	307,494	347,980
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	677,749	645,327	54,219	51,626
	その他	1,398,992	1,471,944	113,560	118,947
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	2,024,254	2,012,739	171,656	170,680
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)	3,851,807	3,146,023	324,564	264,779
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)	865,289	802,902	72,794	67,918
	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%)	730	730	61	61
	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%)	14,901	16,371	1,192	1,310
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%)	47,993	46,454	3,839	3,716
11	未決済取引	2,445	11,575	207	981
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	2,843,773	2,792,025	227,501	223,362
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	762,688	744,184	61,015	59,534
14	うち、外部格付準拠方式適用分	1,403,956	1,397,099	112,316	111,767
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	479,335	518,159	38,346	41,452
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	197,792	132,581	15,823	10,606
16	マーケット・リスク	2,983,576	3,012,892	238,686	241,031
17	うち、標準的方式適用分	927,254	940,350	74,180	75,228
18	うち、内部モデル方式適用分	2,056,321	2,072,541	164,505	165,803
19	オペレーショナル・リスク	8,095,496	8,166,453	647,639	653,316
20	うち、基礎的手法適用分	3,024,040	3,024,040	241,923	241,923
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	5,071,456	5,142,413	405,716	411,393
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	3,831,376	3,675,165	324,900	311,654
	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	15,258,805	14,382,953	1,220,704	1,150,636
25	合計(スケールリングファクター勘案後)	115,124,230	113,066,662	9,209,938	9,045,332