

(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3月末	2019年12月末	2020年3月末	2019年12月末
1	信用リスク	64,560,381	64,009,761	5,342,401	5,300,612
2	うち、標準的手法適用分	22,648,264	21,903,203	1,811,861	1,752,256
3	うち、内部格付手法適用分	36,994,000	37,464,927	3,137,091	3,177,025
	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	4,918,106	4,641,621	393,448	371,329
4	カウンターパーティ信用リスク	9,562,107	8,368,309	772,152	675,575
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	2,588,691	2,447,884	212,613	200,300
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	4,481,503	3,843,682	358,520	307,494
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	702,815	677,749	56,225	54,219
	その他	1,789,096	1,398,992	144,793	113,560
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	1,764,714	2,024,254	149,647	171,656
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)	2,491,620	3,851,807	208,752	324,564
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)	884,471	865,289	74,524	72,794
	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	-	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%)	13,119	14,901	1,049	1,192
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%)	51,567	47,993	4,125	3,839
11	未決済取引	6,519	2,445	552	207
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	2,704,650	2,843,773	216,372	227,501
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	766,604	762,688	61,328	61,015
14	うち、外部格付準拠方式適用分	1,381,935	1,403,956	110,554	112,316
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	424,574	479,335	33,965	38,346
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	131,535	197,792	10,522	15,823
16	マーケット・リスク	3,150,775	2,983,576	252,062	238,686
17	うち、標準的方式適用分	1,125,153	927,254	90,012	74,180
18	うち、内部モデル方式適用分	2,025,621	2,056,321	162,049	164,505
19	オペレーショナル・リスク	8,269,286	8,095,496	661,542	647,639
20	うち、基礎的手法適用分	3,217,023	3,024,040	257,361	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	5,052,263	5,071,456	404,181	405,716
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	3,935,858	3,831,376	333,760	324,900
	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	14,923,809	15,258,805	1,193,904	1,220,704
25	合計(スケールリングファクター勘案後)	115,135,624	115,124,230	9,210,849	9,209,938