

(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6月末	2020年3月末	2020年6月末	2020年3月末
1	信用リスク	65,211,289	64,560,381	5,400,855	5,342,401
2	うち、標準的手法適用分	21,971,981	22,648,264	1,757,758	1,811,861
3	うち、内部格付手法適用分	38,323,433	36,994,000	3,249,827	3,137,091
	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	4,915,865	4,918,106	393,269	393,448
4	カウンターパーティ信用リスク	9,913,228	9,562,107	800,453	772,152
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	2,798,240	2,588,691	229,221	212,613
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	4,664,824	4,481,503	373,185	358,520
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	741,855	702,815	59,348	56,225
	その他	1,708,307	1,789,096	138,698	144,793
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	1,808,338	1,764,714	153,347	149,647
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)	3,127,093	2,491,620	262,115	208,752
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)	783,905	884,471	63,064	74,524
	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%)	41,675	13,119	3,521	1,049
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%)	63,696	51,567	5,095	4,125
11	未決済取引	18,720	6,519	1,586	552
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	2,399,833	2,704,650	191,986	216,372
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	674,999	766,604	53,999	61,328
14	うち、外部格付準拠方式適用分	1,201,821	1,381,935	96,145	110,554
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	393,950	424,574	31,516	33,965
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	129,062	131,535	10,324	10,522
16	マーケット・リスク	3,236,849	3,150,775	258,947	252,062
17	うち、標準的方式適用分	911,586	1,125,153	72,926	90,012
18	うち、内部モデル方式適用分	2,325,262	2,025,621	186,021	162,049
19	オペレーショナル・リスク	8,248,764	8,269,286	659,901	661,542
20	うち、基礎的手法適用分	3,217,023	3,217,023	257,361	257,361
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	5,031,740	5,052,263	402,539	404,181
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	4,039,343	3,935,858	342,536	333,760
	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	13,599,719	14,923,809	1,087,977	1,193,904
25	合計(スケーリングファクター勘案後)	115,392,381	115,135,624	9,231,390	9,210,849