

(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12月末	2020年9月末	2020年12月末	2020年9月末
1	信用リスク	64,786,499	64,480,889	5,369,305	5,340,113
2	うち、標準的手法適用分	21,904,125	22,457,916	1,752,330	1,796,633
3	うち、内部格付手法適用分	38,830,420	37,842,227	3,292,819	3,209,020
	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	4,051,944	4,180,736	324,155	334,458
4	カウンターパーティ信用リスク	9,304,379	9,773,829	750,914	789,502
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	2,588,203	2,649,093	212,156	217,149
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	4,447,145	4,632,565	355,771	370,605
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	736,926	771,062	58,954	61,684
	その他	1,532,103	1,721,108	124,032	140,063
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	1,711,421	1,768,212	145,128	149,944
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)	3,877,312	3,139,488	326,221	260,521
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 (マニフェスト方式)	913,903	816,011	73,519	67,401
	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%)	87,515	41,665	7,407	3,518
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%)	74,762	71,217	5,980	5,697
11	未決済取引	8,533	15,914	723	1,349
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	2,217,264	2,286,814	177,381	182,945
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	1,194,609	1,222,726	95,568	97,818
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	376,877	368,880	30,150	29,510
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	129,433	129,321	10,354	10,345
16	マーケット・リスク	4,027,977	3,460,659	322,238	276,852
17	うち、標準的方式適用分	1,224,400	910,920	97,952	72,873
18	うち、内部モデル方式適用分	2,803,577	2,549,739	224,286	203,979
19	オペレーショナル・リスク	8,543,494	8,163,895	683,479	653,111
20	うち、基礎的手法適用分	3,206,452	3,206,452	256,516	256,516
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	5,337,041	4,957,442	426,963	396,595
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	4,179,629	4,100,585	354,432	347,729
	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	11,198,474	12,328,946	895,877	986,315
25	合計(スケールリングファクター勘案後)	113,907,647	113,312,548	9,112,611	9,065,003