

(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9月末	2019年6月末	2019年9月末	2019年6月末
1	信用リスク	63,232,609	66,221,508	5,235,981	5,488,141
2	うち、標準的手法適用分	21,779,711	21,765,258	1,742,376	1,741,220
3	うち、内部格付手法適用分	36,952,630	39,671,084	3,133,583	3,364,107
	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	10	0	0
	その他	4,500,257	4,785,154	360,020	382,812
4	カウンターパーティ信用リスク	8,920,936	8,769,429	719,903	709,036
5	うち、SA-CGR適用分	-	-	-	-
	うち、カレント・エクスポージャー方式適用分	2,453,911	2,530,690	201,348	208,094
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	4,349,752	4,118,833	347,980	329,506
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	645,327	677,074	51,626	54,165
	その他	1,471,944	1,442,830	118,947	117,268
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	2,012,739	1,978,607	170,680	167,785
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)	3,146,023	3,883,734	264,779	320,478
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 (マナドール方式)	802,902	698,856	67,918	56,187
	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%)	16,371	16,031	1,310	1,282
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%)	46,454	62,398	3,716	4,991
11	未決済取引	11,575	11,972	981	1,014
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	2,792,025	2,906,011	223,362	232,480
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	744,184	817,081	59,534	65,366
14	うち、外部格付準拠方式適用分	1,397,099	1,414,815	111,767	113,185
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	518,159	541,024	41,452	43,281
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	132,581	133,090	10,606	10,647
16	マーケット・リスク	3,012,892	2,685,828	241,031	214,866
17	うち、標準的方式適用分	940,350	877,741	75,228	70,219
18	うち、内部モデル方式適用分	2,072,541	1,808,086	165,803	144,646
19	オペレーショナル・リスク	8,166,453	7,958,462	653,316	636,676
20	うち、基礎的手法適用分	3,024,040	2,627,394	241,923	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	5,142,413	5,331,067	411,393	426,485
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	3,675,165	3,775,064	311,654	320,125
	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	14,382,953	13,320,233	1,150,636	1,065,618
25	合計(スケーリングファクター勘案後)	113,066,662	115,233,589	9,045,332	9,218,687