

(単位:百万円)

OV1:リスク・アセットの概要(三菱UFJ銀行・連結)					
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	57,476,423	57,005,046	4,762,363	4,722,719
2	うち、標準的手法適用分	19,862,320	19,830,741	1,588,985	1,586,459
3	うち、内部格付手法適用分	34,218,656	33,815,813	2,901,742	2,867,580
	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	-	-	-	-
	その他	3,395,445	3,358,491	271,635	268,679
4	カウンターパーティ信用リスク	5,821,670	6,419,882	471,676	519,843
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	1,355,142	1,479,067	113,081	123,727
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	3,302,941	3,866,868	264,235	309,349
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	394,874	375,179	31,589	30,014
	その他	768,712	698,766	62,769	56,752
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	1,559,883	1,565,661	132,278	132,768
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)	2,434,962	1,980,059	205,656	166,914
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)	80,235	56,784	6,803	4,814
	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%)	8,055	190	644	15
11	未決済取引	2,439	11,534	206	978
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	2,284,821	2,249,345	182,785	179,947
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	845,191	854,606	67,615	68,368
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	197,605	132,394	15,808	10,591
16	マーケット・リスク	1,774,659	1,788,597	141,972	143,087
17	うち、標準的方式適用分	432,290	339,920	34,583	27,193
18	うち、内部モデル方式適用分	1,342,369	1,448,676	107,389	115,894
19	オペレーショナル・リスク	5,390,272	5,478,797	431,221	438,303
20	うち、基礎的手法適用分	2,415,846	2,415,846	193,267	193,267
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	2,974,425	3,062,951	237,954	245,036
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	1,323,433	1,295,748	112,227	109,879
	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	17,948,834	16,280,465	1,435,906	1,302,437
25	合計(スケールリングファクター勘案後)	98,562,476	96,538,526	7,884,998	7,723,082