

(単位:百万円)

OV1:リスク・アセットの概要(三菱UFJ銀行・単体)					
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9月末	2020年6月末	2020年9月末	2020年6月末
1	信用リスク	46,440,658	47,277,366	3,931,489	4,002,263
2	うち、標準的手法適用分	-	-	-	-
3	うち、内部格付手法適用分	45,049,418	45,848,749	3,820,190	3,887,973
	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	1,391,240	1,428,617	111,299	114,289
4	カウンターパーティ信用リスク	6,254,605	6,233,095	509,716	507,861
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	1,155,460	1,219,993	97,983	103,455
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	3,940,192	3,955,577	315,215	316,446
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	366,827	357,997	29,346	28,639
	その他	792,125	699,526	67,172	59,319
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	16,944	19,117	1,436	1,621
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)	1,705,610	1,968,169	140,804	165,595
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)	81,647	107,205	8,652	9,088
	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%)	46	54	3	4
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%)	2,903	1,728	232	138
11	未決済取引	15,905	18,535	1,348	1,571
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	1,496,576	1,625,302	119,726	130,024
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	565,886	674,999	45,270	53,999
14	うち、外部格付準拠方式適用分	476,358	473,055	38,108	37,844
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	347,653	370,589	27,812	29,647
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	106,678	106,658	8,534	8,532
16	マーケット・リスク	1,266,722	1,105,610	101,337	88,448
17	うち、標準的方式適用分	77,375	106,346	6,190	8,507
18	うち、内部モデル方式適用分	1,189,346	999,263	95,147	79,941
19	オペレーショナル・リスク	3,010,439	3,027,344	240,835	242,187
20	うち、基礎的手法適用分	27,803	35,313	2,224	2,825
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	2,982,635	2,992,030	238,610	239,362
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	602,038	605,923	51,052	51,382
	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	17,222,397	18,737,810	1,377,791	1,499,024
25	合計(スケーリングファクター勘案後)	81,055,369	83,740,154	6,484,429	6,699,212