

(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3月末	2018年12月末	2019年3月末	2018年12月末
1	信用リスク	59,709,143	58,816,453	4,956,821	4,882,601
2	うち、標準的手法適用分	18,274,785	18,545,591	1,461,982	1,483,647
3	うち、内部格付手法適用分	37,943,768	36,934,431	3,217,631	3,132,039
	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	3,490,588	3,336,430	279,247	266,914
4	カウンターパーティ信用リスク	6,268,839	6,054,266	508,427	491,044
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	1,502,869	1,453,347	126,091	121,882
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	3,651,222	3,431,879	292,097	274,550
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	475,038	526,756	38,003	42,140
	その他	639,709	642,284	52,234	52,471
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	1,504,134	1,537,337	127,550	130,366
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)	2,326,736		196,878	
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)	47,692		4,044	
	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%)	16,333		1,307	
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%)	117,761		9,420	
	複数の資産及び取引を裏付けとするエクスポージャー		-		-
	信用リスク・アセットのみなし計算が適用されるエクスポージャー		2,314,194		196,243
11	未決済取引	82,240	6,027	6,973	511
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	2,620,036	2,051,074	209,602	170,452
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	666,059		53,284	
14	うち、外部格付準拠方式適用分	935,763		74,861	
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	886,176		70,894	
	うち、内部格付手法における外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分		312,884		26,532
	うち、内部格付手法における指定関数方式適用分		906,995		76,913
	うち、標準的手法適用分		340,476		27,238
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	132,036	490,716	10,562	39,768
16	マーケット・リスク	1,191,647	1,092,325	95,331	87,386
17	うち、標準的方式適用分	385,948	397,006	30,875	31,760
18	うち、内部モデル方式適用分	805,698	695,319	64,455	55,625
19	オペレーショナル・リスク	5,230,531	5,138,903	418,442	411,112
20	うち、基礎的手法適用分	2,015,066	1,931,440	161,205	154,515
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	3,215,464	3,207,463	257,237	256,597
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	1,551,645	1,620,972	131,579	137,458
	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	18,071,063	21,679,856	1,445,685	1,734,388
25	合計(スケーリングファクター勘案後)	101,426,318	103,019,561	8,114,105	8,241,564