

(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	
		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	50,264,377	49,252,192	4,252,908	4,169,264
2	うち、標準的手法適用分	-	-	-	-
3	うち、内部格付手法適用分	48,707,924	47,726,817	4,130,432	4,047,234
	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	1,556,452	1,525,375	124,516	122,030
4	カウンターパーティ信用リスク	5,606,255	5,356,748	456,989	436,640
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	1,230,099	1,177,818	104,312	99,879
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	3,477,969	3,268,977	278,237	261,518
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	359,804	400,147	28,784	32,011
	その他	538,381	509,804	45,654	43,231
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	23,779	23,958	2,016	2,031
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)	2,322,982		196,988	
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%)	91		7	
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		2,387,110		202,426
11	未決済取引	82,186	6,018	6,969	510
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	2,366,196	1,326,429	189,295	112,481
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	743,305		59,464	
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	850,265		68,021	
	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		-		-
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	106,566	106,548	8,525	9,035
16	マーケット・リスク	635,031	552,150	50,802	44,172
17	うち、標準的方式適用分	64,724	99,333	5,177	7,946
18	うち、内部モデル方式適用分	570,307	452,816	45,624	36,225
19	オペレーショナル・リスク	3,263,937	3,266,629	261,115	261,330
20	うち、基礎的手法適用分	54,056	64,926	4,324	5,194
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	3,209,881	3,201,703	256,790	256,136
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	1,472,586	1,430,974	124,875	121,346
	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	17,521,666	21,742,920	1,401,733	1,739,433
25	合計(スケーリングファクター勘案後)	86,990,087	88,620,468	6,959,207	7,089,637