

(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6月末	2019年3月末	2019年6月末	2019年3月末
1	信用リスク	50,009,875	50,264,377	4,233,817	4,252,908
2	うち、標準的手法適用分	-	-	-	-
3	うち、内部格付手法適用分	48,547,411	48,707,924	4,116,820	4,130,432
	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	1,462,463	1,556,452	116,997	124,516
4	カウンターパーティ信用リスク	5,766,227	5,606,255	470,352	456,989
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	1,259,548	1,230,099	106,809	104,312
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	3,545,019	3,477,969	283,601	278,237
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	334,955	359,804	26,796	28,784
	その他	626,703	538,381	53,144	45,654
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	20,659	23,779	1,751	2,016
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)	2,343,419	2,322,982	197,843	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)	58,347	47,692	4,946	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%)	81	91	6	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%)	130	117,761	10	9,420
11	未決済取引	11,795	82,186	1,000	6,969
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	2,102,751	2,366,196	168,220	189,295
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	817,081	666,059	65,366	53,284
14	うち、外部格付準拠方式適用分	673,124	743,305	53,849	59,464
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	505,960	850,265	40,476	68,021
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	106,583	106,566	8,526	8,525
16	マーケット・リスク	1,220,174	635,031	97,613	50,802
17	うち、標準的方式適用分	103,628	64,724	8,290	5,177
18	うち、内部モデル方式適用分	1,116,546	570,307	89,323	45,624
19	オペレーショナル・リスク	3,297,153	3,263,937	263,772	261,115
20	うち、基礎的手法適用分	54,056	54,056	4,324	4,324
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	3,243,096	3,209,881	259,447	256,790
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	778,013	1,472,586	65,975	124,875
	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	15,983,354	17,521,666	1,278,668	1,401,733
25	合計(スケーリングファクター勘案後)	84,799,745	86,990,087	6,783,979	6,959,207