

(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9月末   | 2019年6月末   | 2019年9月末  | 2019年6月末  |
| 1                           | 信用リスク  | 57,005,046 | 59,962,713 | 4,722,719 | 4,972,286 |
| 2                           | うち、標準的手法適用分                                      | 19,830,741 | 19,844,323 | 1,586,459 | 1,587,545 |
| 3                           | うち、内部格付手法適用分                                     | 33,815,813 | 36,514,525 | 2,867,580 | 3,096,431 |
|                             | 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  | 3,358,491  | 3,603,865  | 268,679   | 288,309   |
| 4                           | カウンターパーティ信用リスク                                   | 6,419,882  | 6,567,123  | 519,843   | 532,839   |
| 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                            | 1,479,067  | 1,560,798  | 123,727   | 130,869   |
| 6                           | うち、期待エクスポージャー方式適用分                               | -          | -          | -         | -         |
|                             | うち、CVAリスク  | 3,866,868  | 3,739,076  | 309,349   | 299,126   |
|                             | うち、中央清算機関関連エクスポージャー                              | 375,179    | 451,705    | 30,014    | 36,136    |
|                             | その他  | 698,766    | 815,542    | 56,752    | 66,707    |
| 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                       | 1,565,661  | 1,608,546  | 132,768   | 136,404   |
| 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)      | 1,980,059  | 2,362,717  | 166,914   | 199,076   |
| 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(マナド方式)          | 56,784     | 58,347     | 4,814     | 4,946     |
|                             | 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        | -          | 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%)      | 16,371     | 16,031     | 1,310     | 1,282     |
| 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%) | 190        | 130        | 15        | 10        |
| 11                          | 未決済取引  | 11,534     | 11,803     | 978       | 1,000     |
| 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               | 2,249,345  | 2,366,262  | 179,947   | 189,301   |
| 13                          | うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分                         | 744,184    | 817,081    | 59,534    | 65,366    |
| 14                          | うち、外部格付準拠方式適用分                                   | 854,606    | 875,253    | 68,368    | 70,020    |
| 15                          | うち、標準的手法準拠方式適用分                                  | 518,159    | 541,024    | 41,452    | 43,281    |
|                             | うち、1250%のリスク・ウェイト適用分                             | 132,394    | 132,903    | 10,591    | 10,632    |
| 16                          | マーケット・リスク  | 1,788,597  | 1,695,722  | 143,087   | 135,657   |
| 17                          | うち、標準的方式適用分                                      | 339,920    | 397,452    | 27,193    | 31,796    |
| 18                          | うち、内部モデル方式適用分                                    | 1,448,676  | 1,298,270  | 115,894   | 103,861   |
| 19                          | オペレーショナル・リスク                                     | 5,478,797  | 5,263,005  | 438,303   | 421,040   |
| 20                          | うち、基礎的手法適用分                                      | 2,415,846  | 2,015,066  | 193,267   | 161,205   |
| 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                                    | 3,062,951  | 3,247,939  | 245,036   | 259,835   |
| 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                 | 1,295,748  | 1,309,899  | 109,879   | 111,079   |
|                             | 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  | 16,280,465 | 14,571,665 | 1,302,437 | 1,165,733 |
| 25                          | 合計(スケーリングファクター勘案後)                               | 96,538,526 | 98,383,264 | 7,723,082 | 7,870,661 |