

(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9月末	2019年6月末	2019年9月末	2019年6月末
1	信用リスク	47,330,657	50,009,875	4,006,607	4,233,817
2	うち、標準的手法適用分	-	-	-	-
3	うち、内部格付手法適用分	45,865,634	48,547,411	3,889,405	4,116,820
	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	1,465,022	1,462,463	117,201	116,997
4	カウンターパーティ信用リスク	5,509,679	5,766,227	448,510	470,352
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	1,133,467	1,259,548	96,118	106,809
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	3,628,926	3,545,019	290,314	283,601
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	269,031	334,955	21,522	26,796
	その他	478,253	626,703	40,555	53,144
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	18,406	20,659	1,560	1,751
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)	1,978,062	2,343,419	167,134	197,843
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)	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%)	74	81	6	6
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	11,516	11,795	976	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	1,995,789	2,102,751	159,663	168,220
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	657,102	673,124	52,568	53,849
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	487,900	505,960	39,032	40,476
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	106,601	106,583	8,528	8,526
16	マーケット・リスク	1,308,760	1,220,174	104,700	97,613
17	うち、標準的方式適用分	75,667	103,628	6,053	8,290
18	うち、内部モデル方式適用分	1,233,092	1,116,546	98,647	89,323
19	オペレーショナル・リスク	3,104,839	3,297,153	248,387	263,772
20	うち、基礎的手法適用分	42,260	54,056	3,380	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	3,062,579	3,243,096	245,006	259,447
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	783,973	778,013	66,480	65,975
	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	17,665,374	15,983,354	1,413,229	1,278,668
25	合計(スケーリングファクター勘案後)	82,776,876	84,799,745	6,622,150	6,783,979