

(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12月末	2019年9月末	2019年12月末	2019年9月末
1	信用リスク	46,902,545	47,330,657	3,970,381	4,006,607
2	うち、標準的手法適用分	-	-	-	-
3	うち、内部格付手法適用分	45,453,748	45,865,634	3,854,477	3,889,405
	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	1,448,796	1,465,022	115,903	117,201
4	カウンターパーティ信用リスク	4,898,766	5,509,679	399,340	448,510
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	981,090	1,133,467	83,196	96,118
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	3,046,621	3,628,926	243,729	290,314
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	302,365	269,031	24,189	21,522
	その他	568,689	478,253	48,224	40,555
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	19,740	18,406	1,673	1,560
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)	2,434,924	1,978,062	206,088	167,134
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 (マナデート方式)	80,235	56,784	6,803	4,814
	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	730	61	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%)	69	74	5	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%)	1,310	190	104	15
11	未決済取引	2,380	11,516	201	976
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	1,973,733	1,995,789	157,898	159,663
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	762,688	744,184	61,015	59,534
14	うち、外部格付準拠方式適用分	651,673	657,102	52,133	52,568
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	452,750	487,900	36,220	39,032
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	106,620	106,601	8,529	8,528
16	マーケット・リスク	1,247,661	1,308,760	99,812	104,700
17	うち、標準的方式適用分	105,390	75,667	8,431	6,053
18	うち、内部モデル方式適用分	1,142,270	1,233,092	91,381	98,647
19	オペレーショナル・リスク	3,013,621	3,104,839	241,089	248,387
20	うち、基礎的手法適用分	42,260	42,260	3,380	3,380
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	2,971,361	3,062,579	237,708	245,006
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	790,504	783,973	67,034	66,480
	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	19,296,533	17,665,374	1,543,722	1,413,229
25	合計(スケールリングファクター勘案後)	83,677,768	82,776,876	6,694,221	6,622,150