

(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	
		2020年3月末	2019年12月末	2020年3月末	2019年12月末
1	信用リスク	58,895,206	57,476,423	4,877,230	4,762,363
2	うち、標準的手法適用分	20,576,679	19,862,320	1,646,134	1,588,985
3	うち、内部格付手法適用分	34,502,848	34,218,656	2,925,841	2,901,742
	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	3,815,678	3,395,445	305,254	271,635
4	カウンターパーティ信用リスク	7,149,131	5,821,670	579,432	471,676
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	1,633,540	1,355,142	136,735	113,081
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	4,216,366	3,302,941	337,309	264,235
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	411,082	394,874	32,886	31,589
	その他	888,142	768,712	72,501	62,769
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	1,574,524	1,559,883	133,519	132,278
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)	1,598,489	2,434,962	134,298	205,656
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)	86,162	80,235	7,352	6,803
	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%)	13,119	14,901	1,049	1,192
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%)	9,843	8,055	787	644
11	未決済取引	6,490	2,439	550	206
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	2,137,650	2,284,821	171,012	182,785
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	766,604	762,688	61,328	61,015
14	うち、外部格付準拠方式適用分	815,123	845,191	65,209	67,615
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	424,574	479,335	33,965	38,346
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	131,348	197,605	10,507	15,808
16	マーケット・リスク	2,000,040	1,774,659	160,003	141,972
17	うち、標準的方式適用分	444,428	432,290	35,554	34,583
18	うち、内部モデル方式適用分	1,555,612	1,342,369	124,448	107,389
19	オペレーショナル・リスク	5,418,223	5,390,272	433,457	431,221
20	うち、基礎的手法適用分	2,429,229	2,415,846	194,338	193,267
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	2,988,994	2,974,425	239,119	237,954
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	1,257,183	1,323,433	106,609	112,227
	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	16,407,395	17,948,834	1,312,591	1,435,906
25	合計(スケーリングファクター勘案後)	98,973,684	98,562,476	7,917,894	7,884,998