

(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	
		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	46,350,010	46,902,545	3,922,424	3,970,381
2	うち、標準的手法適用分	-	-	-	-
3	うち、内部格付手法適用分	44,671,600	45,453,748	3,788,151	3,854,477
	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	1,678,409	1,448,796	134,272	115,903
4	カウンターパーティ信用リスク	6,212,204	4,898,766	506,207	399,340
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	1,267,207	981,090	107,459	83,196
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	3,969,552	3,046,621	317,564	243,729
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	319,560	302,365	25,564	24,189
	その他	655,884	568,689	55,619	48,224
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	20,509	19,740	1,739	1,673
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)	1,603,993	2,434,924	135,279	206,088
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%)	61	69	5	5
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%)	256	1,310	20	104
11	未決済取引	6,465	2,380	548	201
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	1,884,176	1,973,733	150,734	157,898
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	610,444	651,673	48,835	52,133
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	400,487	452,750	32,039	36,220
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	106,639	106,620	8,531	8,529
16	マーケット・リスク	1,519,920	1,247,661	121,593	99,812
17	うち、標準的方式適用分	108,796	105,390	8,703	8,431
18	うち、内部モデル方式適用分	1,411,124	1,142,270	112,889	91,381
19	オペレーショナル・リスク	3,022,209	3,013,621	241,776	241,089
20	うち、基礎的手法適用分	35,313	42,260	2,825	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	2,986,896	2,971,361	238,951	237,708
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	603,474	790,504	51,174	67,034
	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	17,651,412	19,296,533	1,412,113	1,543,722
25	合計(スケーリングファクター勘案後)	81,887,116	83,677,768	6,550,969	6,694,221