

(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6月末	2020年3月末	2020年6月末	2020年3月末
1	信用リスク	47,277,366	46,350,010	4,002,263	3,922,424
2	うち、標準的手法適用分	-	-	-	-
3	うち、内部格付手法適用分	45,848,749	44,671,600	3,887,973	3,788,151
	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	1,428,617	1,678,409	114,289	134,272
4	カウンターパーティ信用リスク	6,233,095	6,212,204	507,861	506,207
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	1,219,993	1,267,207	103,455	107,459
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	3,955,577	3,969,552	316,446	317,564
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	357,997	319,560	28,639	25,564
	その他	699,526	655,884	59,319	55,619
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	19,117	20,509	1,621	1,739
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)	1,968,169	1,603,993	165,595	135,279
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)	107,205	86,162	9,088	7,352
	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%)	-	-	-	-
	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%)	54	61	4	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%)	1,728	256	138	20
11	未決済取引	18,535	6,465	1,571	548
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	1,625,302	1,884,176	130,024	150,734
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	674,999	766,604	53,999	61,328
14	うち、外部格付準拠方式適用分	473,055	610,444	37,844	48,835
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	370,589	400,487	29,647	32,039
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	106,658	106,639	8,532	8,531
16	マーケット・リスク	1,105,610	1,519,920	88,448	121,593
17	うち、標準的方式適用分	106,346	108,796	8,507	8,703
18	うち、内部モデル方式適用分	999,263	1,411,124	79,941	112,889
19	オペレーショナル・リスク	3,027,344	3,022,209	242,187	241,776
20	うち、基礎的手法適用分	35,313	35,313	2,825	2,825
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	2,992,030	2,986,896	239,362	238,951
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	605,923	603,474	51,382	51,174
	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	18,737,810	17,651,412	1,499,024	1,412,113
25	合計(スケーリングファクター勘案後)	83,740,154	81,887,116	6,699,212	6,550,969