

(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 | |
| | | 2023年9月末 | 2023年6月末 | 2023年9月末 | 2023年6月末 |
| 1 | 信用リスク | 60,591,053 | 60,267,930 | 5,043,178 | 5,019,523 |
| 2 | うち、標準的手法適用分 | 15,697,749 | 14,719,866 | 1,255,819 | 1,177,589 |
| 3 | うち、内部格付手法適用分 | 40,811,247 | 41,268,629 | 3,460,793 | 3,499,579 |
| | 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 | 4,082,055 | 4,279,434 | 326,564 | 342,354 |
| 4 | カウンターパーティ信用リスク | 5,188,981 | 4,974,618 | 423,762 | 406,732 |
| 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 | 1,574,680 | 1,472,329 | 132,241 | 123,773 |
| 6 | うち、期待エクスポージャー方式適用分 | - | - | - | - |
| | うち、CVAリスク | 2,225,350 | 2,122,042 | 178,028 | 169,763 |
| | うち、中央清算機関関連エクスポージャー | 433,400 | 458,154 | 34,672 | 36,652 |
| | その他 | 955,549 | 922,091 | 78,820 | 76,543 |
| 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 | 842,743 | 973,105 | 71,464 | 82,519 |
| 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) | 2,645,247 | 2,571,345 | 224,279 | 218,008 |
| 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) | 457,433 | 517,262 | 38,636 | 42,901 |
| | 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%) | 29,365 | 5,933 | 2,490 | 503 |
| | 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%) | 17,794 | 13,088 | 1,479 | 1,072 |
| 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%) | 2,309 | 1,889 | 184 | 151 |
| 11 | 未決済取引 | 48,795 | 56,391 | 4,124 | 4,766 |
| 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 | 1,954,633 | 1,893,162 | 156,370 | 151,453 |
| 13 | うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分 | 796,073 | 689,539 | 63,685 | 55,163 |
| 14 | うち、外部格付準拠方式適用分 | 491,219 | 473,133 | 39,297 | 37,850 |
| 15 | うち、標準的手法準拠方式適用分 | 560,388 | 623,563 | 44,831 | 49,885 |
| | うち、1250%のリスク・ウェイト適用分 | 106,951 | 106,926 | 8,556 | 8,554 |
| 16 | マーケット・リスク | 2,018,630 | 2,559,998 | 161,490 | 204,799 |
| 17 | うち、標準的方式適用分 | 631,252 | 606,191 | 50,500 | 48,495 |
| 18 | うち、内部モデル方式適用分 | 1,387,377 | 1,953,807 | 110,990 | 156,304 |
| 19 | オペレーショナル・リスク | 5,846,275 | 5,470,493 | 467,702 | 437,639 |
| 20 | うち、基礎的手法適用分 | 2,522,650 | 2,505,787 | 201,812 | 200,463 |
| 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 | 3,323,625 | 2,964,705 | 265,890 | 237,176 |
| 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 | 3,321,751 | 2,883,589 | 281,684 | 244,528 |
| | 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 | 36,917,639 | 32,755,571 | 2,953,411 | 2,620,445 |
| 25 | 合計(スケーリングファクター勘案後) | 122,878,234 | 117,938,075 | 9,830,258 | 9,435,046 |