

(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12月末   | 2023年9月末    | 2023年12月末 | 2023年9月末  |
| 1                           | 信用リスク  | 60,300,534  | 60,591,053  | 5,018,657 | 5,043,178 |
| 2                           | うち、標準的手法適用分                                      | 15,769,898  | 15,697,749  | 1,261,591 | 1,255,819 |
| 3                           | うち、内部格付手法適用分                                     | 40,544,781  | 40,811,247  | 3,438,197 | 3,460,793 |
|                             | 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  | 3,985,854   | 4,082,055   | 318,868   | 326,564   |
| 4                           | カウンターパーティ信用リスク                                   | 5,012,238   | 5,188,981   | 409,354   | 423,762   |
| 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                            | 1,434,779   | 1,574,680   | 120,324   | 132,241   |
| 6                           | うち、期待エクスポージャー方式適用分                               | -           | -           | -         | -         |
|                             | うち、CVAリスク  | 2,174,064   | 2,225,350   | 173,925   | 178,028   |
|                             | うち、中央清算機関関連エクスポージャー                              | 400,706     | 433,400     | 32,056    | 34,672    |
|                             | その他  | 1,002,687   | 955,549     | 83,048    | 78,820    |
| 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                       | 926,900     | 842,743     | 78,601    | 71,464    |
| 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)      | 2,721,804   | 2,645,247   | 230,806   | 224,279   |
| 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)        | 496,085     | 457,433     | 41,905    | 38,636    |
|                             | 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      | -         | 2,490     |
|                             | 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%)      | 26,616      | 17,794      | 2,228     | 1,479     |
| 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%) | 3,231       | 2,309       | 258       | 184       |
| 11                          | 未決済取引  | 55,680      | 48,795      | 4,721     | 4,124     |
| 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               | 1,930,278   | 1,954,633   | 154,422   | 156,370   |
| 13                          | うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分                         | 743,482     | 796,073     | 59,478    | 63,685    |
| 14                          | うち、外部格付準拠方式適用分                                   | 511,774     | 491,219     | 40,941    | 39,297    |
| 15                          | うち、標準的手法準拠方式適用分                                  | 568,043     | 560,388     | 45,443    | 44,831    |
|                             | うち、1250%のリスク・ウェイト適用分                             | 106,978     | 106,951     | 8,558     | 8,556     |
| 16                          | マーケット・リスク  | 2,501,343   | 2,018,630   | 200,107   | 161,490   |
| 17                          | うち、標準的方式適用分                                      | 670,618     | 631,252     | 53,649    | 50,500    |
| 18                          | うち、内部モデル方式適用分                                    | 1,830,725   | 1,387,377   | 146,458   | 110,990   |
| 19                          | オペレーショナル・リスク                                     | 6,240,024   | 5,846,275   | 499,201   | 467,702   |
| 20                          | うち、基礎的手法適用分                                      | 2,522,650   | 2,522,650   | 201,812   | 201,812   |
| 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                                    | 3,717,373   | 3,323,625   | 297,389   | 265,890   |
| 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                 | 2,921,177   | 3,321,751   | 247,715   | 281,684   |
|                             | 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  | 34,936,086  | 36,917,639  | 2,794,886 | 2,953,411 |
| 25                          | 合計(スケーリングファクター勘案後)                               | 121,055,570 | 122,878,234 | 9,684,445 | 9,830,258 |