

(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	
		2024年3月末	2023年12月末	2024年3月末	2023年12月末
1	信用リスク	65,335,709		5,226,856	
2	うち、標準的手法適用分	19,038,822		1,523,105	
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	28,022,582		2,241,806	
4	うち、スロットティング・クライテリア適用分	448,067		35,845	
5	うち、先進的内部格付手法適用分	14,372,122		1,149,769	
	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	3,454,113		276,329	
6	カウンターパーティ信用リスク	4,397,232		351,778	
7	うち、SA-CCR適用分	3,059,629		244,770	
8	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-		-	
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	352,663		28,213	
9	その他	984,939		78,795	
10	CVAリスク	2,069,863		165,589	
	うち、SA-CVA適用分	698,998		55,919	
	うち、完全なBA-CVA適用分	-		-	
	うち、限定的なBA-CVA適用分	1,370,865		109,669	
11	経過措置により適用されるマーケット・ベース方式に基づく株式等エクスポージャー	732,293		58,583	
12	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(レック・スルー方式)	2,709,596		216,767	
13	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)	495,486		39,638	
	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%)	25,084		2,006	
14	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%)	3,643		291	
15	未決済取引	5,208		416	
16	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	2,536,358		202,908	
17	うち、内部格付手法準拠方式適用分	608,347		48,667	
18	うち、外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分	564,988		45,199	
19	うち、標準的手法準拠方式適用分	1,257,254		100,580	
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	105,768		8,461	
20	マーケット・リスク	1,096,148		87,691	
21	うち、標準的方式適用分	1,095,649		87,651	
22	うち、内部モデル方式適用分	-		-	
	うち、簡易的方式適用分	499		39	
23	勘定間の振替分	-		-	
24	オペレーショナル・リスク	5,844,570		467,565	
25	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	2,581,836		206,546	
26	フロア調整	-		-	
27	合計	87,833,033		7,026,642	

(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	
		2024年3月末	2023年12月末	2024年3月末	2023年12月末
1	信用リスク		60,300,534		5,018,657
2	うち、標準的手法適用分		15,769,898		1,261,591
3	うち、内部格付手法適用分		40,544,781		3,438,197
	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		318,868
4	カウンターパーティ信用リスク		5,012,238		409,354
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		120,324
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		173,925
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー		400,706		32,056
	その他		1,002,687		83,048
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		78,601
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		230,806
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)		496,085		41,905
	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%)		26,616		2,228
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		258
11	未決済取引		55,680		4,721
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		154,422
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		59,478
14	うち、外部格付準拠方式適用分		511,774		40,941
15	うち、標準的手法準拠方式適用分		568,043		45,443
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分		106,978		8,558
16	マーケット・リスク		2,501,343		200,107
17	うち、標準的方式適用分		670,618		53,649
18	うち、内部モデル方式適用分		1,830,725		146,458
19	オペレーショナル・リスク		6,240,024		499,201
20	うち、基礎的手法適用分		2,522,650		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		297,389
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		247,715
	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		2,794,886
25	合計(スケーリングファクター勘案後)		121,055,570		9,684,445