

(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	
		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	58,859,611		4,708,768	
2	うち、標準的手法適用分	3,906,067		312,485	
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	38,263,636		3,061,090	
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	14,356,521		1,148,521	
	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	1,885,318		150,825	
6	カウンターパーティ信用リスク	2,491,687		199,334	
7	うち、SA-CCR適用分	2,056,699		164,535	
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	226,788		18,143	
9	その他	208,199		16,655	
10	CVAリスク	1,500,031		120,002	
	うち、SA-CVA適用分	706,008		56,480	
	うち、完全なBA-CVA適用分	-		-	
	うち、限定的なBA-CVA適用分	794,022		63,521	
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	325,936		26,074	
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)	2,888,711		231,096	
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anded方式)	544,613		43,569	
	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%)	19,979		1,598	
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	1,203		96	
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	2,504,144		200,331	
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	552,052		44,164	
19	うち、標準的手法準拠方式適用分	1,237,976		99,038	
	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	559,136		44,730	
21	うち、標準的方式適用分	559,136		44,730	
22	うち、内部モデル方式適用分	-		-	
	うち、簡易的方式適用分	-		-	
23	勘定間の振替分	-		-	
24	オペレーショナル・リスク	3,486,336		278,906	
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	2,178,279		174,262	
26	フロア調整	-		-	
27	合計	75,363,312		6,029,065	

(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	
		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		54,727,536		4,624,464
2	うち、標準的手法適用分		948,740		75,899
3	うち、基礎的内部格付手法適用分		51,304,526		4,350,623
	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		2,474,268		197,941
4	カウンターパーティ信用リスク		4,395,947		361,421
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		1,161,803		98,520
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分		-		-
	うち、CVAリスク		2,081,349		166,507
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー		284,304		22,744
	その他		868,489		73,647
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		213,246		18,083
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 (レック・スルー方式)		2,915,559		247,060
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%)		20,631		1,749
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		55,632		4,717
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		1,906,409		152,512
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		498,900		39,912
15	うち、標準的手法準拠方式適用分		557,049		44,563
	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		1,726,791		138,143
17	うち、標準的方式適用分		157,556		12,604
18	うち、内部モデル方式適用分		1,569,235		125,538
19	オペレーショナル・リスク		3,712,899		297,031
20	うち、基礎的手法適用分		-		-
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		3,712,899		297,031
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		2,306,175		195,563
	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		34,592,049		2,767,363
25	合計(スケーリングファクター勘案後)		110,628,459		8,850,276