

OV1:リスク・アセットの概要(三菱UFJフィナンシャル・グループ)					
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	71,869,773		5,749,581	
2	うち、標準的手法適用分	22,909,435		1,832,754	
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	27,380,420		2,190,433	
4	うち、スロットティング・クワイテリア適用分	448,067		35,845	
5	うち、先進的内部格付手法適用分	15,778,193		1,262,255	
	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	9		0	
	その他	5,353,647		428,291	
6	カウンターパーティ信用リスク	6,774,046		541,923	
7	うち、SA-CCR適用分	3,573,353		285,868	
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	562,756		45,020	
9	その他	2,637,936		211,034	
10	CVAリスク	3,235,812		258,864	
	うち、SA-CVA適用分	646,012		51,681	
	うち、完全なBA-CVA適用分	-		-	
	うち、限定的なBA-CVA適用分	2,589,799		207,183	
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	1,206,521		96,521	
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(ルック・スルー方式)	4,368,634		349,490	
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)	2,137,470		170,997	
	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%)	53,114		4,249	
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%)	550,544		44,043	
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	3,663,457		293,076	
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	1,159,250		92,740	
19	うち、標準的手法準拠方式適用分	1,789,903		143,192	
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	105,955		8,476	
20	マーケット・リスク	2,513,152		201,052	
21	うち、標準的方式適用分	2,424,652		193,972	
22	うち、内部モデル方式適用分	-		-	
	うち、簡易的方式適用分	88,500		7,080	
23	勘定間の振替分	-		-	
24	オペレーショナル・リスク	9,141,395		731,311	
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	5,641,043		451,283	
26	フロア調整	-		-	
27	合計	111,160,175		8,892,814	

(単位:百万円)

OV1:リスク・アセットの概要(三菱UFJフィナンシャル・グループ)					
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		65,346,947		5,431,411
2	うち、標準的手法適用分		18,351,928		1,468,154
3	うち、内部格付手法適用分		42,428,289		3,597,918
	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		9		0
	その他		4,566,720		365,337
4	カウンターパーティ信用リスク		8,741,726		707,177
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		2,478,763		203,345
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分		-		-
	うち、CVAリスク		3,257,011		260,560
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー		679,731		54,378
	その他		2,326,220		188,893
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		1,402,011		118,890
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)		4,388,889		369,451
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)		2,262,535		183,180
	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%)		54,451		4,588
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%)		98,618		7,889
11	未決済取引		51		4
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		2,544,507		203,560
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		1,125,816		90,065
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		107,165		8,573
16	マーケット・リスク		8,884,777		710,782
17	うち、標準的方式適用分		1,528,517		122,281
18	うち、内部モデル方式適用分		7,356,259		588,500
19	オペレーショナル・リスク		9,224,109		737,928
20	うち、基礎的手法適用分		3,385,835		270,866
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		5,838,274		467,061
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		5,668,472		480,686
	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		23,185,031		1,854,802
25	合計(スケーリングファクター勘案後)		135,149,165		10,811,933