

(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6月末	2024年3月末	2024年6月末	2024年3月末
1	信用リスク	66,213,605	65,335,709	5,297,088	5,226,856
2	うち、標準的手法適用分	19,784,023	19,038,822	1,582,721	1,523,105
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	28,512,883	28,022,582	2,281,030	2,241,806
4	うち、スロッシング・クライテリア適用分	370,679	448,067	29,654	35,845
5	うち、先進的内部格付手法適用分	13,832,413	14,372,122	1,106,593	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	3,713,604	3,454,113	297,088	276,329
6	カウンターパーティ信用リスク	3,996,401	4,397,232	319,712	351,778
7	うち、SA-CCR適用分	2,885,951	3,059,629	230,876	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	406,037	352,663	32,482	28,213
9	その他	704,412	984,939	56,352	78,795
10	CVAリスク	2,331,710	2,069,863	186,537	165,589
	うち、SA-CVA適用分	827,383	698,998	66,191	55,919
	うち、完全なBA-CVA適用分	-	-	-	-
	うち、限定的なBA-CVA適用分	1,504,327	1,370,865	120,346	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	638,063	732,293	51,045	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)	2,383,190	2,709,596	190,655	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)	1,108,833	495,486	88,706	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%)	44,189	25,084	3,535	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%)	5,590	3,643	447	291
15	未決済取引	35,119	5,208	2,809	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	2,670,794	2,536,358	213,663	202,908
17	うち、内部格付手法準拠方式適用分	667,060	608,347	53,364	48,667
18	うち、外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分	608,247	564,988	48,659	45,199
19	うち、標準的手法準拠方式適用分	1,289,718	1,257,254	103,177	100,580
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	105,768	105,768	8,461	8,461
20	マーケット・リスク	1,354,666	1,096,148	108,373	87,691
21	うち、標準的方式適用分	1,354,160	1,095,649	108,332	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	506	499	40	39
23	勘定間の振替分	-	-	-	-
24	オペレーショナル・リスク	5,844,570	5,844,570	467,565	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	3,030,843	2,581,836	242,467	206,546
26	フロア調整	-	-	-	-
27	合計	89,657,578	87,833,033	7,172,606	7,026,642