

(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6月末	2024年3月末	2024年6月末	2024年3月末
1	信用リスク	58,710,191	58,859,611	4,696,815	4,708,768
2	うち、標準的手法適用分	3,914,313	3,906,067	313,145	312,485
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	38,824,076	38,263,636	3,105,926	3,061,090
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	13,817,268	14,356,521	1,105,381	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	1,783,853	1,885,318	142,708	150,825
6	カウンターパーティ信用リスク	2,567,347	2,491,687	205,387	199,334
7	うち、SA-CCR適用分	2,184,323	2,056,699	174,745	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	219,332	226,788	17,546	18,143
9	その他	163,691	208,199	13,095	16,655
10	CVAリスク	1,746,474	1,500,031	139,718	120,002
	うち、SA-CVA適用分	835,434	706,008	66,835	56,480
	うち、完全なBA-CVA適用分	-	-	-	-
	うち、限定的なBA-CVA適用分	911,040	794,022	72,883	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)	2,567,963	2,888,711	205,437	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 (マンドート方式)	1,157,429	544,613	92,594	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%)	39,902	19,979	3,192	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%)	5,590	3,643	447	291
15	未決済取引	34,388	1,203	2,751	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	2,652,123	2,504,144	212,169	200,331
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	598,760	552,052	47,900	44,164
19	うち、標準的手法準拠方式適用分	1,280,534	1,237,976	102,442	99,038
	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	797,781	559,136	63,822	44,730
21	うち、標準的方式適用分	797,781	559,136	63,822	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	3,486,336	278,906	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	2,588,132	2,178,279	207,050	174,262
26	フロア調整	-	-	-	-
27	合計	76,353,662	75,363,312	6,108,293	6,029,065