

(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6月末	2024年3月末	2024年6月末	2024年3月末
1	信用リスク	73,363,939	71,869,773	5,869,115	5,749,581
2	うち、標準的手法適用分	23,683,552	22,909,435	1,894,684	1,832,754
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	28,068,716	27,380,420	2,245,497	2,190,433
4	うち、スロットティング・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	15,285,848	15,778,193	1,222,867	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	9	0	0
	その他	5,955,133	5,353,647	476,410	428,291
6	カウンターパーティ信用リスク	7,148,597	6,774,046	571,887	541,923
7	うち、SA-CCR適用分	3,628,700	3,573,353	290,296	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	551,720	562,756	44,137	45,020
9	その他	2,968,175	2,637,936	237,454	211,034
10	CVAリスク	3,463,285	3,235,812	277,063	258,864
	うち、SA-CVA適用分	767,432	646,012	61,395	51,681
	うち、完全なBA-CVA適用分	-	-	-	-
	うち、限定的なBA-CVA適用分	2,695,853	2,589,799	215,668	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	1,034,121	1,206,521	82,729	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 (リスク・スルー方式)	4,181,217	4,368,634	334,497	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)	3,114,678	2,137,470	249,174	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%)	44,304	53,114	3,544	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%)	90,165	550,544	7,213	44,043
15	未決済取引	35,153	5,208	2,812	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	3,828,974	3,663,457	306,317	293,076
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	1,182,275	1,159,250	94,582	92,740
19	うち、標準的手法準拠方式適用分	1,873,683	1,789,903	149,894	143,192
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	105,955	105,955	8,476	8,476
20	マーケット・リスク	2,543,068	2,513,152	203,445	201,052
21	うち、標準的方式適用分	2,501,779	2,424,652	200,142	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	41,289	88,500	3,303	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	9,141,395	731,311	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	5,712,656	5,641,043	457,012	451,283
26	フロア調整	-	-	-	-
27	合計	113,701,559	111,160,175	9,096,124	8,892,814