

(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9月末	2024年6月末	2024年9月末	2024年6月末
1	信用リスク	54,801,118	58,710,191	4,384,089	4,696,815
2	うち、標準的手法適用分	3,529,287	3,914,313	282,342	313,145
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	36,447,447	38,824,076	2,915,795	3,105,926
4	うち、スロットティング・クライテリア適用分	214,216	370,679	17,137	29,654
5	うち、先進的内部格付手法適用分	12,954,362	13,817,268	1,036,348	1,105,381
	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	1,655,804	1,783,853	132,464	142,708
6	カウンターパーティ信用リスク	2,453,525	2,567,347	196,282	205,387
7	うち、SA-CCR適用分	2,001,189	2,184,323	160,095	174,745
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	200,393	219,332	16,031	17,546
9	その他	251,941	163,691	20,155	13,095
10	CVAリスク	1,485,849	1,746,474	118,867	139,718
	うち、SA-CVA適用分	713,032	835,434	57,042	66,835
	うち、完全なBA-CVA適用分	-	-	-	-
	うち、限定的なBA-CVA適用分	772,817	911,040	61,825	72,883
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	-	-	-	-
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)	2,761,099	2,567,963	220,887	205,437
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)	1,103,061	1,157,429	88,244	92,594
	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%)	25,000	-	2,000	-
	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%)	71,517	39,902	5,721	3,192
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%)	3,438	5,590	275	447
15	未決済取引	3,474	34,388	277	2,751
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	2,479,144	2,652,123	198,331	212,169
17	うち、内部格付手法準拠方式適用分	593,802	667,060	47,504	53,364
18	うち、外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分	562,083	598,760	44,966	47,900
19	うち、標準的手法準拠方式適用分	1,217,490	1,280,534	97,399	102,442
	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	965,659	797,781	77,252	63,822
21	うち、標準的方式適用分	965,659	797,781	77,252	63,822
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	3,773,834	3,486,336	301,906	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	2,420,377	2,588,132	193,630	207,050
26	フロア調整	-	-	-	-
27	合計	72,347,099	76,353,662	5,787,767	6,108,293