

(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9月末	2024年6月末	2024年9月末	2024年6月末
1	信用リスク	69,234,005	73,363,939	5,538,720	5,869,115
2	うち、標準的手法適用分	23,388,785	23,683,552	1,871,102	1,894,684
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	25,675,614	28,068,716	2,054,049	2,245,497
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	14,426,934	15,285,848	1,154,154	1,222,867
	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	5,528,445	5,955,133	442,275	476,410
6	カウンターパーティ信用リスク	5,803,544	7,148,597	464,283	571,887
7	うち、SA-CCR適用分	3,123,752	3,628,700	249,900	290,296
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	413,626	551,720	33,090	44,137
9	その他	2,266,166	2,968,175	181,293	237,454
10	CVAリスク	3,187,472	3,463,285	254,997	277,063
	うち、SA-CVA適用分	679,307	767,432	54,344	61,395
	うち、完全なBA-CVA適用分	-	-	-	-
	うち、限定的なBA-CVA適用分	2,508,164	2,695,853	200,653	215,668
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	992,746	1,034,121	79,419	82,729
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)	4,296,666	4,181,217	343,733	334,497
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)	2,828,606	3,114,678	226,288	249,174
	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%)	201,150	44,304	16,092	3,544
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%)	100,735	90,165	8,058	7,213
15	未決済取引	5,672	35,153	453	2,812
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	3,474,984	3,828,974	277,998	306,317
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	1,022,933	1,182,275	81,834	94,582
19	うち、標準的手法準拠方式適用分	1,752,292	1,873,683	140,183	149,894
	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	2,941,123	2,543,068	235,289	203,445
21	うち、標準的方式適用分	2,927,697	2,501,779	234,215	200,142
22	うち、内部モデル方式適用分	-	-	-	-
	うち、簡易的方式適用分	13,425	41,289	1,074	3,303
23	勘定間の振替分	-	-	-	-
24	オペレーショナル・リスク	10,025,952	9,141,395	802,076	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	5,864,168	5,712,656	469,133	457,012
26	フロア調整	-	-	-	-
27	合計	108,956,829	113,701,559	8,716,546	9,096,124