

(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12月末	2024年9月末	2024年12月末	2024年9月末
1	信用リスク	55,772,037	54,801,118	4,461,762	4,384,089
2	うち、標準的手法適用分	2,704,412	3,529,287	216,353	282,342
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	37,422,473	36,447,447	2,993,797	2,915,795
4	うち、スロッシング・クライテリア適用分	379,351	214,216	30,348	17,137
5	うち、先進的内部格付手法適用分	13,251,358	12,954,362	1,060,108	1,036,348
	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	2,014,440	1,655,804	161,155	132,464
6	カウンターパーティ信用リスク	2,328,257	2,453,525	186,260	196,282
7	うち、SA-CCR適用分	1,860,000	2,001,189	148,800	160,095
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	191,953	200,393	15,356	16,031
9	その他	276,303	251,941	22,104	20,155
10	CVAリスク	1,586,566	1,485,849	126,925	118,867
	うち、SA-CVA適用分	664,727	713,032	53,178	57,042
	うち、完全なBA-CVA適用分	-	-	-	-
	うち、限定的なBA-CVA適用分	921,838	772,817	73,747	61,825
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)	2,959,321	2,761,099	236,745	220,887
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)	1,176,176	1,103,061	94,094	88,244
	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	25,000	2,000	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%)	51,328	71,517	4,106	5,721
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%)	3,117	3,438	249	275
15	未決済取引	2,677	3,474	214	277
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	2,704,539	2,479,144	216,363	198,331
17	うち、内部格付手法準拠方式適用分	623,097	593,802	49,847	47,504
18	うち、外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分	595,100	562,083	47,608	44,966
19	うち、標準的手法準拠方式適用分	1,380,573	1,217,490	110,445	97,399
	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	801,675	965,659	64,134	77,252
21	うち、標準的方式適用分	801,675	965,659	64,134	77,252
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	3,773,834	301,906	301,906
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	3,224,581	2,420,377	257,966	193,630
26	フロア調整	-	-	-	-
27	合計	74,409,113	72,347,099	5,952,729	5,787,767