

(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12月末	2024年9月末	2024年12月末	2024年9月末
1	信用リスク	69,769,327	69,234,005	5,581,546	5,538,720
2	うち、標準的手法適用分	22,482,377	23,388,785	1,798,590	1,871,102
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	26,441,698	25,675,614	2,115,335	2,054,049
4	うち、スロットティング・クワイテリア適用分	379,351	214,216	30,348	17,137
5	うち、先進的内部格付手法適用分	14,746,399	14,426,934	1,179,711	1,154,154
	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	5,719,490	5,528,445	457,559	442,275
6	カウンターパーティ信用リスク	5,847,045	5,803,544	467,763	464,283
7	うち、SA-CCR適用分	3,345,380	3,123,752	267,630	249,900
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	461,499	413,626	36,919	33,090
9	その他	2,040,166	2,266,166	163,213	181,293
10	CVAリスク	3,101,376	3,187,472	248,110	254,997
	うち、SA-CVA適用分	621,475	679,307	49,718	54,344
	うち、完全なBA-CVA適用分	-	-	-	-
	うち、限定的なBA-CVA適用分	2,479,901	2,508,164	198,392	200,653
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	1,006,390	992,746	80,511	79,419
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)	4,050,536	4,296,666	324,042	343,733
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)	2,995,994	2,828,606	239,679	226,288
	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%)	187,721	201,150	15,017	16,092
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%)	201,664	100,735	16,133	8,058
15	未決済取引	3,868	5,672	309	453
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	3,777,391	3,474,984	302,191	277,998
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	1,059,163	1,022,933	84,733	81,834
19	うち、標準的手法準拠方式適用分	1,989,174	1,752,292	159,133	140,183
	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	3,540,085	2,941,123	283,206	235,289
21	うち、標準的方式適用分	3,524,477	2,927,697	281,958	234,215
22	うち、内部モデル方式適用分	-	-	-	-
	うち、簡易的方式適用分	15,607	13,425	1,248	1,074
23	勘定間の振替分	-	-	-	-
24	オペレーショナル・リスク	10,025,952	10,025,952	802,076	802,076
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	5,723,453	5,864,168	457,876	469,133
26	フロア調整	-	-	-	-
27	合計	110,230,808	108,956,829	8,818,464	8,716,546