

(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    |           |
|                                    |                                                  | 2025年3月末    | 2024年12月末   | 2025年3月末  | 2024年12月末 |
| 1                                  | 信用リスク                                            | 68,138,424  | 69,769,327  | 5,451,073 | 5,581,546 |
| 2                                  | うち、標準的手法適用分                                      | 23,439,898  | 22,482,377  | 1,875,191 | 1,798,590 |
| 3                                  | うち、基礎的内部格付手法適用分                                  | 24,598,233  | 26,441,698  | 1,967,858 | 2,115,335 |
| 4                                  | うち、スロットティング・クライテリア適用分                            | 391,326     | 379,351     | 31,306    | 30,348    |
| 5                                  | うち、先進的内部格付手法適用分                                  | 14,288,978  | 14,746,399  | 1,143,118 | 1,179,711 |
|                                    | 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                                              | 5,419,978   | 5,719,490   | 433,598   | 457,559   |
| 6                                  | カウンターパーティ信用リスク                                   | 5,491,631   | 5,847,045   | 439,330   | 467,763   |
| 7                                  | うち、SA-CCR適用分                                     | 2,927,947   | 3,345,380   | 234,235   | 267,630   |
| 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                              | 471,855     | 461,499     | 37,748    | 36,919    |
| 9                                  | その他                                              | 2,091,828   | 2,040,166   | 167,346   | 163,213   |
| 10                                 | CVAリスク                                           | 2,901,170   | 3,101,376   | 232,093   | 248,110   |
|                                    | うち、SA-CVA適用分                                     | 573,482     | 621,475     | 45,878    | 49,718    |
|                                    | うち、完全なBA-CVA適用分                                  | -           | -           | -         | -         |
|                                    | うち、限定的なBA-CVA適用分                                 | 2,327,688   | 2,479,901   | 186,215   | 198,392   |
| 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           | 1,118,679   | 1,006,390   | 89,494    | 80,511    |
| 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)      | 4,490,837   | 4,050,536   | 359,266   | 324,042   |
| 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)        | 2,691,258   | 2,995,994   | 215,300   | 239,679   |
|                                    | 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%)      | 1,495       | -           | 119       | -         |
|                                    | 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%)      | 190,349     | 187,721     | 15,227    | 15,017    |
| 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%) | 147,929     | 201,664     | 11,834    | 16,133    |
| 15                                 | 未決済取引                                            | 23,847      | 3,868       | 1,907     | 309       |
| 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               | 3,805,410   | 3,777,391   | 304,432   | 302,191   |
| 17                                 | うち、内部格付手法準拠方式適用分                                 | 271,110     | 623,097     | 21,688    | 49,847    |
| 18                                 | うち、外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分                           | 1,048,350   | 1,059,163   | 83,868    | 84,733    |
| 19                                 | うち、標準的手法準拠方式適用分                                  | 2,379,994   | 1,989,174   | 190,399   | 159,133   |
|                                    | 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                                        | 2,543,863   | 3,540,085   | 203,509   | 283,206   |
| 21                                 | うち、標準的方式適用分                                      | 2,532,021   | 3,524,477   | 202,561   | 281,958   |
| 22                                 | うち、内部モデル方式適用分                                    | -           | -           | -         | -         |
|                                    | うち、簡易的方式適用分                                      | 11,841      | 15,607      | 947       | 1,248     |
| 23                                 | 勘定間の振替分                                          | -           | -           | -         | -         |
| 24                                 | オペレーショナル・リスク                                     | 9,696,371   | 10,025,952  | 775,709   | 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                 | 5,689,210   | 5,723,453   | 455,136   | 457,876   |
| 26                                 | フロア調整                                            | -           | -           | -         | -         |
| 27                                 | 合計                                               | 106,930,480 | 110,230,808 | 8,554,438 | 8,818,464 |