

(単位:百万円)

OV1:リスク・アセットの概要(三菱UFJ信託銀行・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	
		2023年6月末	2023年3月末	2023年6月末	2023年3月末
1	信用リスク	2,741,651	2,490,703	230,943	209,656
2	うち、標準的手法適用分	174	3,780	13	302
3	うち、内部格付手法適用分	2,419,003	2,166,671	205,131	183,733
	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	322,472	320,251	25,797	25,620
4	カウンターパーティ信用リスク	608,222	355,802	50,287	29,527
5	うち、SA-CCR適用分	-	-	-	-
	うち、カレント・エクスポージャー方式適用分	249,897	108,043	21,191	9,162
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	252,276	120,071	20,182	9,605
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	16,357	14,284	1,308	1,142
	その他	89,690	113,402	7,605	9,616
7	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	2,378,347	2,371,273	201,683	201,083
8	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)	1,438,366	1,486,986	120,648	124,961
9	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 (マニフェスト方式)	1,683,166	1,509,667	134,656	120,776
	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%)	78,321	72,392	6,641	6,138
10	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%)	103,575	110,884	8,286	8,870
11	未決済取引	-	-	-	-
12	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	622,100	598,538	49,768	47,883
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	-	-	-	-
14	うち、外部格付準拠方式適用分	621,912	598,351	49,753	47,868
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	-	-	-	-
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	187	187	15	15
16	マーケット・リスク	872,783	586,271	69,822	46,901
17	うち、標準的方式適用分	2,702	1,550	216	124
18	うち、内部モデル方式適用分	870,081	584,721	69,606	46,777
19	オペレーショナル・リスク	765,011	765,965	61,200	61,277
20	うち、基礎的手法適用分	0	-	0	-
21	うち、粗利益配分手法適用分	-	-	-	-
22	うち、先進的計測手法適用分	765,011	765,965	61,200	61,277
23	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	155,223	148,853	13,162	12,622
	経過措置によりリスク・アセットの額に算入されるものの額	-	-	-	-
24	フロア調整	-	-	-	-
25	合計(スケーリングファクター勘案後)	11,838,786	10,871,248	947,102	869,699