

(単位:百万円)

OV1:リスク・アセットの概要(三菱UFJ信託銀行・連結)					
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9月末	2023年6月末	2023年9月末	2023年6月末
1	信用リスク	2,481,091	3,121,880	209,055	260,065
2	うち、標準的手法適用分	279,399	260,973	22,351	20,877
3	うち、内部格付手法適用分	2,201,692	2,148,969	186,703	182,232
	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	775,562	711,937	62,045	56,955
4	カウンターパーティ信用リスク	503,177	606,798	41,546	50,054
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	158,633	225,495	13,452	19,122
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	184,906	245,030	14,792	19,602
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	49,006	47,005	3,920	3,760
	その他	110,631	89,267	9,381	7,569
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	160,513	157,837	13,611	13,384
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)	1,401,916	1,353,536	117,597	113,461
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)	1,840,419	1,794,810	147,237	143,588
	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%)	82,281	78,321	6,977	6,641
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%)	108,878	107,101	8,710	8,568
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	642,637	625,055	51,411	50,004
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	642,450	624,868	51,396	49,989
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	984,174	1,091,057	78,733	87,284
17	うち、標準的方式適用分	224,345	220,975	17,947	17,678
18	うち、内部モデル方式適用分	759,828	870,081	60,786	69,606
19	オペレーショナル・リスク	1,427,506	1,394,207	114,200	111,536
20	うち、基礎的手法適用分	559,213	525,211	44,737	42,016
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	868,293	868,995	69,463	69,519
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	275,227	217,730	23,339	18,463
	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)	10,930,824	10,788,166	874,465	863,053