

(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12月末 | 2023年9月末 | 2023年12月末 | 2023年9月末 |
| 1 | 信用リスク | 3,242,041 | 2,481,091 | 269,588 | 209,055 |
| 2 | うち、標準的手法適用分 | 324,896 | 279,399 | 25,991 | 22,351 |
| 3 | うち、内部格付手法適用分 | 2,130,146 | 2,201,692 | 180,636 | 186,703 |
| | 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 | 786,998 | 775,562 | 62,959 | 62,045 |
| 4 | カウンターパーティ信用リスク | 340,298 | 503,177 | 28,010 | 41,546 |
| 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 | 73,826 | 158,633 | 6,260 | 13,452 |
| 6 | うち、期待エクスポージャー方式適用分 | - | - | - | - |
| | うち、CVAリスク | 110,152 | 184,906 | 8,812 | 14,792 |
| | うち、中央清算機関関連エクスポージャー | 66,308 | 49,006 | 5,304 | 3,920 |
| | その他 | 90,011 | 110,631 | 7,632 | 9,381 |
| 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 | 252,888 | 160,513 | 21,444 | 13,611 |
| 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) | 1,416,769 | 1,401,916 | 118,705 | 117,597 |
| 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) | 1,808,529 | 1,840,419 | 144,685 | 147,237 |
| | 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%) | 27,835 | 82,281 | 2,360 | 6,977 |
| 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%) | 95,386 | 108,878 | 7,630 | 8,710 |
| 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 | 614,228 | 642,637 | 49,138 | 51,411 |
| 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 | 614,041 | 642,450 | 49,123 | 51,396 |
| 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 | 909,795 | 984,174 | 72,783 | 78,733 |
| 17 | うち、標準的方式適用分 | 227,232 | 224,345 | 18,178 | 17,947 |
| 18 | うち、内部モデル方式適用分 | 682,563 | 759,828 | 54,605 | 60,786 |
| 19 | オペレーショナル・リスク | 1,232,602 | 1,427,506 | 98,608 | 114,200 |
| 20 | うち、基礎的手法適用分 | 559,213 | 559,213 | 44,737 | 44,737 |
| 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 | 673,388 | 868,293 | 53,871 | 69,463 |
| 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 | 253,984 | 275,227 | 21,537 | 23,339 |
| | 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) | 10,431,181 | 10,930,824 | 834,494 | 874,465 |