

(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	
		2022年9月末	2022年6月末	2022年9月末	2022年6月末
1	信用リスク	3,031,105	3,075,490	252,483	256,245
2	うち、標準的手法適用分	254,696	279,291	20,375	22,343
3	うち、内部格付手法適用分	2,082,212	2,126,260	176,571	180,306
	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	694,196	669,938	55,535	53,595
4	カウンターパーティ信用リスク	480,585	572,094	39,723	47,190
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	160,514	210,197	13,611	17,824
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	187,503	248,911	15,000	19,912
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	27,168	26,743	2,173	2,139
	その他	105,399	86,242	8,937	7,313
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	228,160	222,856	19,348	18,898
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)	1,396,792	1,606,714	117,257	135,127
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)	1,585,164	1,515,005	126,816	121,203
	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%)	95,571	111,904	8,104	9,489
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%)	95,907	89,947	7,672	7,195
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	611,750	556,084	48,940	44,486
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	611,562	555,897	48,925	44,471
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	711,321	666,170	56,905	53,293
17	うち、標準的方式適用分	129,852	128,179	10,388	10,254
18	うち、内部モデル方式適用分	581,468	537,991	46,517	43,039
19	オペレーショナル・リスク	1,156,432	1,132,559	92,515	90,605
20	うち、基礎的手法適用分	514,563	492,487	41,165	39,399
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	641,869	640,072	51,350	51,206
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	316,099	205,316	26,805	17,410
	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)	9,957,131	10,014,327	796,570	801,146