

(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	
		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	2,625,716	2,705,872	221,325	228,024
2	うち、標準的手法適用分	0	-	0	-
3	うち、内部格付手法適用分	2,347,491	2,407,193	199,067	204,130
	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	278,225	298,678	22,258	23,894
4	カウンターパーティ信用リスク	482,716	573,417	40,006	47,397
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	182,832	231,119	15,504	19,598
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	180,999	240,565	14,479	19,245
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	12,218	15,382	977	1,230
	その他	106,665	86,350	9,045	7,322
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	2,383,776	2,332,020	202,144	197,755
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)	1,477,383	1,657,379	123,999	139,333
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)	1,478,363	1,413,014	118,272	113,044
	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%)	93,165	87,192	7,453	6,975
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	587,845	533,358	47,027	42,668
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	587,657	533,170	47,012	42,653
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	582,670	546,266	46,613	43,701
17	うち、標準的方式適用分	1,201	8,274	96	661
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	595,764	597,694	47,661	47,815
20	うち、基礎的手法適用分	0	43	0	3
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	595,764	597,650	47,661	47,812
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	258,163	150,499	21,892	12,762
	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)	11,056,256	11,112,099	884,500	888,967