

(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12月末	2022年9月末	2022年12月末	2022年9月末
1	信用リスク	2,933,995	3,031,105	243,579	252,483
2	うち、標準的手法適用分	293,220	254,696	23,457	20,375
3	うち、内部格付手法適用分	1,845,817	2,082,212	156,525	176,571
	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	794,957	694,196	63,596	55,535
4	カウンターパーティ信用リスク	311,369	480,585	25,738	39,723
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	69,040	160,514	5,854	13,611
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	104,710	187,503	8,376	15,000
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	33,964	27,168	2,717	2,173
	その他	103,653	105,399	8,789	8,937
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	140,772	228,160	11,937	19,348
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)	1,355,664	1,396,792	113,887	117,257
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)	1,569,513	1,585,164	125,564	126,816
	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%)	91,346	95,571	7,746	8,104
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%)	116,990	95,907	9,359	7,672
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	551,572	611,750	44,125	48,940
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	551,384	611,562	44,110	48,925
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	535,577	711,321	42,846	56,905
17	うち、標準的方式適用分	154,469	129,852	12,357	10,388
18	うち、内部モデル方式適用分	381,107	581,468	30,488	46,517
19	オペレーショナル・リスク	1,384,555	1,156,432	110,764	92,515
20	うち、基礎的手法適用分	514,563	514,563	41,165	41,165
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	869,991	641,869	69,599	51,350
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	310,313	316,099	26,314	26,805
	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)	9,523,304	9,957,131	761,864	796,570