

(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	2,398,474	2,625,716	202,016	221,325
2	うち、標準的手法適用分	-	-	-	-
3	うち、内部格付手法適用分	2,112,193	2,347,491	179,113	199,067
	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	286,280	278,225	22,902	22,258
4	カウンターパーティ信用リスク	273,902	482,716	22,770	40,006
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	75,091	182,832	6,367	15,504
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	83,839	180,999	6,707	14,479
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	11,313	12,218	905	977
	その他	103,657	106,665	8,790	9,045
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	2,362,764	2,383,776	200,362	202,144
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)	1,443,439	1,477,383	121,233	123,999
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 (マンドート方式)	1,456,631	1,478,363	116,534	118,272
	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%)	114,434	93,165	9,154	7,453
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	529,410	587,845	42,352	47,027
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	529,223	587,657	42,337	47,012
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	382,609	582,670	30,608	46,613
17	うち、標準的方式適用分	1,501	1,201	120	96
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	766,845	595,764	61,347	47,661
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
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	766,845	595,764	61,347	47,661
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	239,698	258,163	20,326	21,892
	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)	10,430,667	11,056,256	834,453	884,500