

(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3月末	2022年12月末	2023年3月末	2022年12月末
1	信用リスク	2,893,531	2,933,995	240,604	243,579
2	うち、標準的手法適用分	283,343	293,220	22,667	23,457
3	うち、内部格付手法適用分	1,900,446	1,845,817	161,157	156,525
	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	709,741	794,957	56,779	63,596
4	カウンターパーティ信用リスク	368,006	311,369	30,428	25,738
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	94,886	69,040	8,046	5,854
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	120,358	104,710	9,628	8,376
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	41,831	33,964	3,346	2,717
	その他	110,930	103,653	9,406	8,789
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	152,177	140,772	12,904	11,937
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)	1,417,443	1,355,664	119,064	113,887
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)	1,625,884	1,569,513	130,074	125,564
	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%)	72,392	91,346	6,138	7,746
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%)	113,638	116,990	9,091	9,359
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	601,519	551,572	48,121	44,125
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	601,331	551,384	48,106	44,110
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	795,146	535,577	63,611	42,846
17	うち、標準的方式適用分	210,424	154,469	16,833	12,357
18	うち、内部モデル方式適用分	584,721	381,107	46,777	30,488
19	オペレーショナル・リスク	1,396,331	1,384,555	111,706	110,764
20	うち、基礎的手法適用分	525,211	514,563	42,016	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	871,119	869,991	69,689	69,599
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	215,563	310,313	18,279	26,314
	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)	9,875,319	9,523,304	790,025	761,864