

(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	
		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	2,490,703	2,398,474	209,656	202,016
2	うち、標準的手法適用分	3,780	-	302	-
3	うち、内部格付手法適用分	2,166,671	2,112,193	183,733	179,113
	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	320,251	286,280	25,620	22,902
4	カウンターパーティ信用リスク	355,802	273,902	29,527	22,770
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	108,043	75,091	9,162	6,367
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	120,071	83,839	9,605	6,707
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	14,284	11,313	1,142	905
	その他	113,402	103,657	9,616	8,790
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	2,371,273	2,362,764	201,083	200,362
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)	1,486,986	1,443,439	124,961	121,233
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)	1,509,667	1,456,631	120,776	116,534
	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%)	110,884	114,434	8,870	9,154
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	598,538	529,410	47,883	42,352
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	598,351	529,223	47,868	42,337
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	586,271	382,609	46,901	30,608
17	うち、標準的方式適用分	1,550	1,501	124	120
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	765,965	766,845	61,277	61,347
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	765,965	766,845	61,277	61,347
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	148,853	239,698	12,622	20,326
	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)	10,871,248	10,430,667	869,699	834,453