

(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6月末	2023年3月末	2023年6月末	2023年3月末
1	信用リスク	3,121,880	2,893,531	260,065	240,604
2	うち、標準的手法適用分	260,973	283,343	20,877	22,667
3	うち、内部格付手法適用分	2,148,969	1,900,446	182,232	161,157
	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	711,937	709,741	56,955	56,779
4	カウンターパーティ信用リスク	606,798	368,006	50,054	30,428
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	225,495	94,886	19,122	8,046
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	245,030	120,358	19,602	9,628
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	47,005	41,831	3,760	3,346
	その他	89,267	110,930	7,569	9,406
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	157,837	152,177	13,384	12,904
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)	1,353,536	1,417,443	113,461	119,064
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)	1,794,810	1,625,884	143,588	130,074
	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%)	78,321	72,392	6,641	6,138
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%)	107,101	113,638	8,568	9,091
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	625,055	601,519	50,004	48,121
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	624,868	601,331	49,989	48,106
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	1,091,057	795,146	87,284	63,611
17	うち、標準的方式適用分	220,975	210,424	17,678	16,833
18	うち、内部モデル方式適用分	870,081	584,721	69,606	46,777
19	オペレーショナル・リスク	1,394,207	1,396,331	111,536	111,706
20	うち、基礎的手法適用分	525,211	525,211	42,016	42,016
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	868,995	871,119	69,519	69,689
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	217,730	215,563	18,463	18,279
	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)	10,788,166	9,875,319	863,053	790,025