

(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9月末	2023年6月末	2023年9月末	2023年6月末
1	信用リスク	2,787,225	2,741,651	234,816	230,943
2	うち、標準的手法適用分	98	174	7	13
3	うち、内部格付手法適用分	2,466,245	2,419,003	209,137	205,131
	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	320,881	322,472	25,670	25,797
4	カウンターパーティ信用リスク	492,567	608,222	40,817	50,287
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	181,592	249,897	15,399	21,191
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	181,180	252,276	14,494	20,182
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	17,099	16,357	1,367	1,308
	その他	112,694	89,690	9,556	7,605
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	2,426,858	2,378,347	205,797	201,683
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)	1,477,649	1,438,366	124,008	120,648
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)	1,720,297	1,683,166	137,627	134,656
	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%)	82,281	78,321	6,977	6,641
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%)	105,440	103,575	8,435	8,286
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	639,649	622,100	51,171	49,768
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	639,461	621,912	51,156	49,753
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	764,637	872,783	61,170	69,822
17	うち、標準的方式適用分	4,808	2,702	384	216
18	うち、内部モデル方式適用分	759,828	870,081	60,786	69,606
19	オペレーショナル・リスク	766,624	765,011	61,329	61,200
20	うち、基礎的手法適用分	0	0	0	0
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	766,624	765,011	61,329	61,200
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	209,407	155,223	17,757	13,162
	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)	11,873,881	11,838,786	949,910	947,102