

(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12月末	2023年9月末	2023年12月末	2023年9月末
1	信用リスク	2,715,264	2,787,225	228,726	234,816
2	うち、標準的手法適用分	50	98	4	7
3	うち、内部格付手法適用分	2,396,896	2,466,245	203,256	209,137
	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	318,317	320,881	25,465	25,670
4	カウンターパーティ信用リスク	304,119	492,567	25,174	40,817
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	85,986	181,592	7,291	15,399
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	101,102	181,180	8,088	14,494
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	27,019	17,099	2,161	1,367
	その他	90,011	112,694	7,632	9,556
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	2,699,624	2,426,858	228,928	205,797
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)	1,496,230	1,477,649	125,432	124,008
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)	1,684,261	1,720,297	134,744	137,627
	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%)	27,835	82,281	2,360	6,977
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%)	93,663	105,440	7,493	8,435
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	611,239	639,649	48,899	51,171
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	611,052	639,461	48,884	51,156
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	686,155	764,637	54,892	61,170
17	うち、標準的方式適用分	3,591	4,808	287	384
18	うち、内部モデル方式適用分	682,563	759,828	54,605	60,786
19	オペレーショナル・リスク	609,660	766,624	48,772	61,329
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	609,660	766,624	48,772	61,329
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	187,509	209,407	15,900	17,757
	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)	11,516,561	11,873,881	921,324	949,910