

(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	
		2024年3月末	2023年12月末	2024年3月末	2023年12月末
1	信用リスク	3,178,665		254,293	
2	うち、標準的手法適用分	891,268		71,301	
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	983,822		78,705	
4	うち、スロットティング・クライテリア適用分	-		-	
5	うち、先進的内部格付手法適用分	243,989		19,519	
	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	1,059,584		84,766	
6	カウンターパーティ信用リスク	429,644		34,371	
7	うち、SA-CCR適用分	269,424		21,553	
8	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-		-	
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	50,524		4,041	
9	その他	109,694		8,775	
10	CVAリスク	329,562		26,365	
	うち、SA-CVA適用分	-		-	
	うち、完全なBA-CVA適用分	-		-	
	うち、限定的なBA-CVA適用分	329,562		26,365	
11	経過措置により適用されるマーケット・ベース方式に基づく株式等エクスポージャー	239,859		19,188	
12	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（レック・スルー方式）	1,264,631		101,170	
13	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）	1,643,500		131,480	
	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％）	27,915		2,233	
14	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％）	546,900		43,752	
15	未決済取引	-		-	
16	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	1,127,098		90,167	
17	うち、内部格付手法準拠方式適用分	-		-	
18	うち、外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分	594,261		47,540	
19	うち、標準的手法準拠方式適用分	532,649		42,611	
	うち、1250％のリスク・ウェイト適用分	187		15	
20	マーケット・リスク	236,561		18,924	
21	うち、標準的方式適用分	154,876		12,390	
22	うち、内部モデル方式適用分	-		-	
	うち、簡易的方式適用分	81,685		6,534	
23	勘定間の振替分	-		-	
24	オペレーショナル・リスク	1,202,313		96,185	
25	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	160,790		12,863	
26	フロア調整	-		-	
27	合計	10,387,442		830,995	

(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	
		2024年3月末	2023年12月末	2024年3月末	2023年12月末
1	信用リスク		3,242,041		269,588
2	うち、標準的手法適用分		324,896		25,991
3	うち、内部格付手法適用分		2,130,146		180,636
	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		786,998		62,959
4	カウンターパーティ信用リスク		340,298		28,010
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		73,826		6,260
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分		-		-
	うち、CVAリスク		110,152		8,812
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー		66,308		5,304
	その他		90,011		7,632
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		252,888		21,444
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）		1,416,769		118,705
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（マંデート方式）		1,808,529		144,685
	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		2,360
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%）		95,386		7,630
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		614,228		49,138
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		614,041		49,123
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		15
16	マーケット・リスク		909,795		72,783
17	うち、標準的方式適用分		227,232		18,178
18	うち、内部モデル方式適用分		682,563		54,605
19	オペレーショナル・リスク		1,232,602		98,608
20	うち、基礎的手法適用分		559,213		44,737
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		673,388		53,871
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		253,984		21,537
	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（スクーリングファクター勘案後）		10,431,181		834,494