

(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	
		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	2,612,879		209,030	
2	うち、標準的手法適用分	737,832		59,026	
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	1,262,939		101,035	
4	うち、スロッシング・クライテリア適用分	-		-	
5	うち、先進的内部格付手法適用分	243,356		19,468	
	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	368,749		29,499	
6	カウンターパーティ信用リスク	448,283		35,862	
7	うち、SA-CCR適用分	314,133		25,130	
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	33,923		2,713	
9	その他	100,226		8,018	
10	CVAリスク	379,519		30,361	
	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	379,519		30,361	
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	2,648,830		211,906	
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 (ルック・スルー方式)	1,362,797		109,023	
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)	1,502,817		120,225	
	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%)	539,573		43,165	
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	1,124,330		89,946	
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	591,494		47,319	
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	157,214		12,577	
21	うち、標準的方式適用分	157,214		12,577	
22	うち、内部モデル方式適用分	-		-	
	うち、簡易的方式適用分	-		-	
23	勘定間の振替分	-		-	
24	オペレーショナル・リスク	664,896		53,191	
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	136,921		10,953	
26	フロア調整	-		-	
27	合計	11,605,979		928,478	

(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	
		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		2,715,264		228,726
2	うち、標準的手法適用分		50		4
3	うち、内部格付手法適用分		2,396,896		203,256
	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		25,465
4	カウンターパーティ信用リスク		304,119		25,174
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		7,291
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		8,088
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー		27,019		2,161
	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		2,699,624		228,928
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 (レック・スルー方式)		1,496,230		125,432
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)		1,684,261		134,744
	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%)		93,663		7,493
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		48,899
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		48,884
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		686,155		54,892
17	うち、標準的方式適用分		3,591		287
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		609,660		48,772
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		48,772
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		15,900
	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		921,324