

(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6月末	2024年3月末	2024年6月末	2024年3月末
1	信用リスク	3,200,512	3,178,665	256,041	254,293
2	うち、標準的手法適用分	753,683	891,268	60,294	71,301
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	1,072,184	983,822	85,774	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	270,520	243,989	21,641	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	1,104,124	1,059,584	88,329	84,766
6	カウンターパーティ信用リスク	597,093	429,644	47,767	34,371
7	うち、SA-CCR適用分	467,460	269,424	37,396	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	53,824	50,524	4,305	4,041
9	その他	75,808	109,694	6,064	8,775
10	CVAリスク	273,375	329,562	21,870	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	273,375	329,562	21,870	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	152,741	239,859	12,219	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）	1,388,353	1,264,631	111,068	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）	1,978,375	1,643,500	158,270	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％）	84,574	546,900	6,765	43,752
15	未決済取引	34	-	2	-
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	1,157,913	1,127,098	92,633	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	573,760	594,261	45,900	47,540
19	うち、標準的手法準拠方式適用分	583,964	532,649	46,717	42,611
	うち、1250％のリスク・ウェイト適用分	187	187	15	15
20	マーケット・リスク	202,657	236,561	16,212	18,924
21	うち、標準的方式適用分	169,508	154,876	13,560	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	33,148	81,685	2,651	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	1,202,313	96,185	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	229,052	160,790	18,324	12,863
26	フロア調整	-	-	-	-
27	合計	10,466,996	10,387,442	837,359	830,995