

(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6月末	2024年3月末	2024年6月末	2024年3月末
1	信用リスク	2,641,143	2,612,879	211,291	209,030
2	うち、標準的手法適用分	705,855	737,832	56,468	59,026
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	1,302,304	1,262,939	104,184	101,035
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	269,944	243,356	21,595	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	363,038	368,749	29,043	29,499
6	カウンターパーティ信用リスク	479,939	448,283	38,395	35,862
7	うち、SA-CCR適用分	375,306	314,133	30,024	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	35,682	33,923	2,854	2,713
9	その他	68,950	100,226	5,516	8,018
10	CVAリスク	313,057	379,519	25,044	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	313,057	379,519	25,044	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	2,762,531	2,648,830	221,002	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（レック・スルー方式）	1,437,017	1,362,797	114,961	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）	1,840,257	1,502,817	147,220	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％）	76,877	539,573	6,150	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	1,131,354	1,124,330	90,508	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	572,870	591,494	45,829	47,319
19	うち、標準的手法準拠方式適用分	558,296	532,649	44,663	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	85,590	157,214	6,847	12,577
21	うち、標準的方式適用分	85,590	157,214	6,847	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	664,896	53,191	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	151,365	136,921	12,109	10,953
26	フロア調整	-	-	-	-
27	合計	11,584,030	11,605,979	926,722	928,478