

(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9月末	2024年6月末	2024年9月末	2024年6月末
1	信用リスク	2,858,026	3,200,512	228,642	256,041
2	うち、標準的手法適用分	603,184	753,683	48,254	60,294
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	932,144	1,072,184	74,571	85,774
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	263,858	270,520	21,108	21,641
	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	1,058,840	1,104,124	84,707	88,329
6	カウンターパーティ信用リスク	354,434	597,093	28,354	47,767
7	うち、SA-CCR適用分	233,401	467,460	18,672	37,396
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	49,763	53,824	3,981	4,305
9	その他	71,269	75,808	5,701	6,064
10	CVAリスク	234,079	273,375	18,726	21,870
	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	234,079	273,375	18,726	21,870
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	94,894	152,741	7,591	12,219
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）	1,245,782	1,388,353	99,662	111,068
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）	1,698,181	1,978,375	135,854	158,270
	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％）	-	-	-	-
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％）	97,297	84,574	7,783	6,765
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	981,909	1,157,913	78,552	92,633
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	454,738	573,760	36,379	45,900
19	うち、標準的手法準拠方式適用分	526,982	583,964	42,158	46,717
	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	223,893	202,657	17,911	16,212
21	うち、標準的方式適用分	217,762	169,508	17,420	13,560
22	うち、内部モデル方式適用分	-	-	-	-
	うち、簡易的方式適用分	6,131	33,148	490	2,651
23	勘定間の振替分	-	-	-	-
24	オペレーショナル・リスク	1,395,897	1,202,313	111,671	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	287,946	229,052	23,035	18,324
26	フロア調整	-	-	-	-
27	合計	9,472,343	10,466,996	757,787	837,359