

(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	2,256,489	2,641,143	180,519	211,291
2	うち、標準的手法適用分	556,962	705,855	44,556	56,468
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	1,124,043	1,302,304	89,923	104,184
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	263,322	269,944	21,065	21,595
	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	312,161	363,038	24,972	29,043
6	カウンターパーティ信用リスク	281,888	479,939	22,551	38,395
7	うち、SA-CCR適用分	184,366	375,306	14,749	30,024
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	32,042	35,682	2,563	2,854
9	その他	65,479	68,950	5,238	5,516
10	CVAリスク	242,352	313,057	19,388	25,044
	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	242,352	313,057	19,388	25,044
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	2,666,572	2,762,531	213,325	221,002
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）	1,302,607	1,437,017	104,208	114,961
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）	1,634,157	1,840,257	130,732	147,220
	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%）	89,589	76,877	7,167	6,150
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	950,305	1,131,354	76,024	90,508
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	453,849	572,870	36,307	45,829
19	うち、標準的手法準拠方式適用分	496,268	558,296	39,701	44,663
	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	121,493	85,590	9,719	6,847
21	うち、標準的方式適用分	121,493	85,590	9,719	6,847
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	673,295	664,896	53,863	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	205,068	151,365	16,405	12,109
26	フロア調整	-	-	-	-
27	合計	10,423,820	11,584,030	833,905	926,722