

(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12月末	2024年9月末	2024年12月末	2024年9月末
1	信用リスク	2,263,481	2,256,489	181,078	180,519
2	うち、標準的手法適用分	536,564	556,962	42,925	44,556
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	1,127,416	1,124,043	90,193	89,923
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	255,336	263,322	20,426	21,065
	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	344,162	312,161	27,533	24,972
6	カウンターパーティ信用リスク	552,475	281,888	44,198	22,551
7	うち、SA-CCR適用分	425,805	184,366	34,064	14,749
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	36,197	32,042	2,895	2,563
9	その他	90,473	65,479	7,237	5,238
10	CVAリスク	337,305	242,352	26,984	19,388
	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	337,305	242,352	26,984	19,388
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	2,830,975	2,666,572	226,478	213,325
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）	1,013,073	1,302,607	81,045	104,208
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）	1,652,592	1,634,157	132,207	130,732
	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％）	88,381	89,589	7,070	7,167
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	1,001,580	950,305	80,126	76,024
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	460,177	453,849	36,814	36,307
19	うち、標準的手法準拠方式適用分	541,215	496,268	43,297	39,701
	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	174,790	121,493	13,983	9,719
21	うち、標準的方式適用分	174,790	121,493	13,983	9,719
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	673,295	53,863	53,863
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	249,606	205,068	19,968	16,405
26	フロア調整	-	-	-	-
27	合計	10,837,558	10,423,820	867,004	833,905