

(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   |           |
|                               |                                                  | 2025年3月末   | 2024年12月末  | 2025年3月末 | 2024年12月末 |
| 1                             | 信用リスク                                            | 2,520,417  | 2,263,481  | 201,633  | 181,078   |
| 2                             | うち、標準的手法適用分                                      | 874,808    | 536,564    | 69,984   | 42,925    |
| 3                             | うち、基礎的内部格付手法適用分                                  | 1,075,840  | 1,127,416  | 86,067   | 90,193    |
| 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                                  | 234,297    | 255,336    | 18,743   | 20,426    |
|                               | 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                                              | 335,470    | 344,162    | 26,837   | 27,533    |
| 6                             | カウンターパーティ信用リスク                                   | 329,263    | 552,475    | 26,341   | 44,198    |
| 7                             | うち、SA-CCR適用分                                     | 205,805    | 425,805    | 16,464   | 34,064    |
| 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                              | 31,995     | 36,197     | 2,559    | 2,895     |
| 9                             | その他                                              | 91,463     | 90,473     | 7,317    | 7,237     |
| 10                            | CVAリスク                                           | 275,922    | 337,305    | 22,073   | 26,984    |
|                               | 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                                 | 275,922    | 337,305    | 22,073   | 26,984    |
| 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           | 2,868,712  | 2,830,975  | 229,497  | 226,478   |
| 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）      | 984,583    | 1,013,073  | 78,766   | 81,045    |
| 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）        | 1,809,355  | 1,652,592  | 144,748  | 132,207   |
|                               | 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%） | 443        | 88,381     | 35       | 7,070     |
| 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               | 995,167    | 1,001,580  | 79,613   | 80,126    |
| 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                           | 434,784    | 460,177    | 34,782   | 36,814    |
| 19                            | うち、標準的手法準拠方式適用分                                  | 560,196    | 541,215    | 44,815   | 43,297    |
|                               | 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                                        | 161,367    | 174,790    | 12,909   | 13,983    |
| 21                            | うち、標準的方式適用分                                      | 161,367    | 174,790    | 12,909   | 13,983    |
| 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                                     | 679,337    | 673,295    | 54,346   | 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                 | 219,939    | 249,606    | 17,595   | 19,968    |
| 26                            | フロア調整                                            | -          | -          | -        | -         |
| 27                            | 合計                                               | 10,844,510 | 10,837,558 | 867,560  | 867,004   |