

(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	
		2020年3月末	2019年12月末	2020年3月末	2019年12月末
1	信用リスク	2,940,427	3,253,854	245,794	272,807
2	うち、標準的手法適用分	257,843	259,008	20,627	20,720
3	うち、内部格付手法適用分	2,199,989	2,604,002	186,559	220,819
	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	482,594	390,843	38,607	31,267
4	カウンターパーティ信用リスク	314,438	330,656	25,942	27,323
5	うち、SA-CCR適用分	-	-	-	-
	うち、カレント・エクスポージャー方式適用分	80,008	90,525	6,784	7,676
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	124,098	127,103	9,927	10,168
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	26,216	22,152	2,097	1,772
	その他	84,114	90,874	7,132	7,706
7	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	93,058	361,749	7,891	30,676
8	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 (ルック・スルー方式)	750,548	1,266,131	63,256	107,087
9	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)	798,309	785,053	67,172	65,991
	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%)	-	-	-	-
10	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%)	41,724	39,938	3,337	3,195
11	未決済取引	-	-	-	-
12	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	566,999	558,952	45,359	44,716
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	-	-	-	-
14	うち、外部格付準拠方式適用分	566,812	558,765	45,344	44,701
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	-	-	-	-
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	187	187	15	15
16	マーケット・リスク	516,665	769,600	41,333	61,568
17	うち、標準的方式適用分	118,771	87,751	9,501	7,020
18	うち、内部モデル方式適用分	397,893	681,848	31,831	54,547
19	オペレーショナル・リスク	1,014,073	835,326	81,125	66,826
20	うち、基礎的手法適用分	432,041	253,418	34,563	20,273
21	うち、粗利益配分手法適用分	-	-	-	-
22	うち、先進的計測手法適用分	582,031	581,908	46,562	46,552
23	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	146,676	175,607	12,438	14,891
	経過措置によりリスク・アセットの額に算入されるものの額	-	-	-	-
24	フロア調整	-	-	-	-
25	合計(スケーリングファクター勘案後)	7,420,655	8,688,533	593,652	695,082