

(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6月末	2020年3月末	2020年6月末	2020年3月末
1	信用リスク	2,981,693	2,940,427	249,355	245,794
2	うち、標準的手法適用分	185,197	257,843	14,815	20,627
3	うち、内部格付手法適用分	2,254,211	2,199,989	191,157	186,559
	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	542,284	482,594	43,382	38,607
4	カウンターパーティ信用リスク	293,437	314,438	24,201	25,942
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	62,483	80,008	5,298	6,784
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	118,524	124,098	9,481	9,927
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	23,503	26,216	1,880	2,097
	その他	88,925	84,114	7,540	7,132
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	129,542	93,058	10,985	7,891
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)	1,009,264	750,548	85,243	63,256
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)	709,982	798,309	56,798	67,172
	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%)	39,051	-	3,311	-
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%)	55,846	41,724	4,467	3,337
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	542,173	566,999	43,373	45,359
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	541,986	566,812	43,358	45,344
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	513,212	516,665	41,057	41,333
17	うち、標準的方式適用分	113,535	118,771	9,082	9,501
18	うち、内部モデル方式適用分	399,677	397,893	31,974	31,831
19	オペレーショナル・リスク	1,015,712	1,014,073	81,256	81,125
20	うち、基礎的手法適用分	432,041	432,041	34,563	34,563
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	583,670	582,031	46,693	46,562
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	141,500	146,676	11,999	12,438
	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)	7,650,639	7,420,655	612,051	593,652