

(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	
		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	2,781,657	2,696,357	234,606	227,310
2	うち、標準的手法適用分	-	-	-	-
3	うち、内部格付手法適用分	2,515,441	2,417,161	213,309	204,975
	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	266,216	279,195	21,297	22,335
4	カウンターパーティ信用リスク	270,748	302,087	22,452	25,023
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	72,906	90,551	6,182	7,678
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	93,961	110,178	7,516	8,814
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	11,658	13,540	932	1,083
	その他	92,221	87,816	7,820	7,446
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	1,817,764	1,776,041	154,146	150,608
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)	1,157,272	901,579	97,401	75,676
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(マニフェスト方式)	638,396	719,224	51,071	60,855
	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%)	52,866	33,829	4,229	2,706
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	441,461	460,801	35,316	36,864
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	441,274	460,614	35,301	36,849
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	407,896	414,362	32,631	33,148
17	うち、標準的方式適用分	8,218	16,468	657	1,317
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	533,099	532,386	42,647	42,590
20	うち、基礎的手法適用分	21	21	1	1
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	533,078	532,364	42,646	42,589
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	183,964	187,849	15,600	15,929
	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)	8,667,708	8,383,920	693,416	670,713