

(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9月末	2020年6月末	2020年9月末	2020年6月末
1	信用リスク	3,087,491	2,981,693	258,448	249,355
2	うち、標準的手法適用分	179,229	185,197	14,338	14,815
3	うち、内部格付手法適用分	2,385,226	2,254,211	202,267	191,157
	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	523,035	542,284	41,842	43,382
4	カウンターパーティ信用リスク	266,610	293,437	21,980	24,201
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	55,856	62,483	4,736	5,298
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	106,182	118,524	8,494	9,481
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	24,590	23,503	1,967	1,880
	その他	79,980	88,925	6,782	7,540
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	125,149	129,542	10,612	10,985
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)	1,282,148	1,009,264	108,277	85,243
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)	734,363	709,982	58,749	56,798
	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%)	38,510	39,051	3,265	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%)	55,520	55,846	4,441	4,467
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	555,380	542,173	44,430	43,373
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	555,193	541,986	44,415	43,358
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	597,922	513,212	47,833	41,057
17	うち、標準的方式適用分	110,145	113,535	8,811	9,082
18	うち、内部モデル方式適用分	487,777	399,677	39,022	31,974
19	オペレーショナル・リスク	986,944	1,015,712	78,955	81,256
20	うち、基礎的手法適用分	403,760	432,041	32,300	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	583,184	583,670	46,654	46,693
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	125,375	141,500	10,631	11,999
	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)	8,095,351	7,650,639	647,628	612,051