

(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9月末	2020年6月末	2020年9月末	2020年6月末
1	信用リスク	2,878,577	2,781,657	242,879	234,606
2	うち、標準的手法適用分	-	-	-	-
3	うち、内部格付手法適用分	2,623,682	2,515,441	222,488	213,309
	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	254,895	266,216	20,391	21,297
4	カウンターパーティ信用リスク	245,799	270,748	20,348	22,452
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	62,383	72,906	5,290	6,182
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	90,980	93,961	7,278	7,516
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	12,119	11,658	969	932
	その他	80,316	92,221	6,810	7,820
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	1,846,972	1,817,764	156,623	154,146
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)	1,434,791	1,157,272	120,830	97,401
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)	659,919	638,396	52,793	51,071
	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%)	53,349	52,866	4,267	4,229
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	456,835	441,461	36,546	35,316
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	456,647	441,274	36,531	35,301
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	495,936	407,896	39,674	32,631
17	うち、標準的方式適用分	8,159	8,218	652	657
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	533,944	533,099	42,715	42,647
20	うち、基礎的手法適用分	30	21	2	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	533,914	533,078	42,713	42,646
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	90,957	183,964	7,713	15,600
	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)	9,095,755	8,667,708	727,660	693,416