

(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	
		2021年9月末	2021年6月末	2021年9月末	2021年6月末
1	信用リスク	3,078,983	3,062,536	259,809	258,390
2	うち、標準的手法適用分	-	-	-	-
3	うち、内部格付手法適用分	2,810,597	2,789,137	238,338	236,518
	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	268,385	273,398	21,470	21,871
4	カウンターパーティ信用リスク	322,891	271,508	26,753	22,436
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	95,900	82,951	8,132	7,034
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	115,737	105,246	9,258	8,419
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	15,007	17,118	1,200	1,369
	その他	96,246	66,192	8,161	5,613
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	2,185,549	2,083,774	185,334	176,704
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)	1,827,815	1,879,298	153,836	158,352
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)	1,006,171	917,202	80,496	73,378
	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%)	76,533	76,562	6,490	6,492
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%)	36,297	31,937	2,903	2,554
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	427,864	410,069	34,229	32,805
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	427,676	409,881	34,214	32,790
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	468,322	741,910	37,465	59,352
17	うち、標準的方式適用分	250	25	20	2
18	うち、内部モデル方式適用分	468,072	741,885	37,445	59,350
19	オペレーショナル・リスク	553,170	551,929	44,254	44,154
20	うち、基礎的手法適用分	60	21	5	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	553,109	551,907	44,249	44,152
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	96,638	102,335	8,194	8,678
	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)	10,497,104	10,541,268	839,768	843,301