

(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	
		2022年6月末	2022年3月末	2022年6月末	2022年3月末
1	信用リスク	3,075,490	3,158,131	256,245	263,348
2	うち、標準的手法適用分	279,291	262,693	22,343	21,015
3	うち、内部格付手法適用分	2,126,260	2,228,800	180,306	189,002
	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	669,938	666,637	53,595	53,330
4	カウンターパーティ信用リスク	572,094	592,309	47,190	48,892
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	210,197	222,923	17,824	18,903
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	248,911	257,140	19,912	20,571
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	26,743	21,128	2,139	1,690
	その他	86,242	91,117	7,313	7,726
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	222,856	146,671	18,898	12,437
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)	1,606,714	1,370,413	135,127	115,189
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)	1,515,005	1,349,848	121,203	107,991
	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%)	111,904	99,787	9,489	8,462
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%)	89,947	87,540	7,195	7,003
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	556,084	511,216	44,486	40,897
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	555,897	511,028	44,471	40,882
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	666,170	669,814	53,293	53,585
17	うち、標準的方式適用分	128,179	118,854	10,254	9,508
18	うち、内部モデル方式適用分	537,991	550,959	43,039	44,076
19	オペレーショナル・リスク	1,132,559	1,136,242	90,605	90,899
20	うち、基礎的手法適用分	492,487	492,487	39,399	39,399
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	640,072	643,756	51,206	51,500
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	205,316	110,462	17,410	9,367
	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)	10,014,327	9,475,913	801,146	758,073