

(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	
		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	2,705,872	2,823,496	228,024	237,858
2	うち、標準的手法適用分	-	-	-	-
3	うち、内部格付手法適用分	2,407,193	2,495,586	204,130	211,625
	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	298,678	327,910	23,894	26,232
4	カウンターパーティ信用リスク	573,417	602,795	47,397	49,845
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	231,119	246,403	19,598	20,895
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	240,565	254,292	19,245	20,343
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	15,382	10,692	1,230	855
	その他	86,350	91,407	7,322	7,751
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	2,332,020	2,216,789	197,755	187,983
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)	1,657,379	1,419,326	139,333	119,256
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)	1,413,014	1,266,261	113,044	101,304
	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%)	87,192	84,891	6,975	6,791
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	533,358	490,951	42,668	39,276
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	533,170	490,764	42,653	39,261
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	546,266	551,419	43,701	44,113
17	うち、標準的方式適用分	8,274	459	661	36
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	597,694	595,743	47,815	47,659
20	うち、基礎的手法適用分	43	43	3	3
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	597,650	595,699	47,812	47,656
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	150,499	88,211	12,762	7,480
	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)	11,112,099	10,625,381	888,967	850,030