

(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	
		2019年12月末	2019年9月末	2019年12月末	2019年9月末
1	信用リスク	3,253,854	3,228,456	272,807	270,843
2	うち、標準的手法適用分	259,008	171,551	20,720	13,724
3	うち、内部格付手法適用分	2,604,002	2,618,136	220,819	222,018
	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	390,843	438,767	31,267	35,101
4	カウンターパーティ信用リスク	330,656	277,938	27,323	22,953
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	90,525	65,387	7,676	5,544
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	127,103	105,697	10,168	8,455
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	22,152	22,667	1,772	1,813
	その他	90,874	84,186	7,706	7,138
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	361,749	343,963	30,676	29,168
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)	1,266,131	1,047,062	107,087	88,599
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)	785,053	746,117	65,991	63,103
	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%)	-	-	-	-
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%)	39,938	39,519	3,195	3,161
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	558,952	542,679	44,716	43,414
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	558,765	542,492	44,701	43,399
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	769,600	919,609	61,568	73,568
17	うち、標準的方式適用分	87,751	81,201	7,020	6,496
18	うち、内部モデル方式適用分	681,848	838,408	54,547	67,072
19	オペレーショナル・リスク	835,326	800,585	66,826	64,046
20	うち、基礎的手法適用分	253,418	253,418	20,273	20,273
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	581,908	547,167	46,552	43,773
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	175,607	170,327	14,891	14,443
	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)	8,688,533	8,416,297	695,082	673,303