

(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	
		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	3,089,023	3,107,274	260,628	262,178
2	うち、標準的手法適用分	-	-	-	-
3	うち、内部格付手法適用分	2,813,950	2,832,607	238,622	240,205
	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	275,073	274,667	22,005	21,973
4	カウンターパーティ信用リスク	312,007	260,285	25,883	21,597
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	100,786	75,413	8,546	6,395
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	109,014	86,647	8,721	6,931
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	10,629	12,152	850	972
	その他	91,577	86,072	7,765	7,298
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	1,967,300	1,866,047	166,827	158,240
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)	1,439,812	1,222,444	121,393	103,068
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)	715,007	671,985	60,387	56,817
	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%)	32,042	32,373	2,563	2,589
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	456,123	458,824	36,489	36,705
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	455,936	458,636	36,474	36,690
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	699,441	855,783	55,955	68,462
17	うち、標準的方式適用分	17,593	17,375	1,407	1,390
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	532,247	489,905	42,579	39,192
20	うち、基礎的手法適用分	30	30	2	2
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	532,217	489,875	42,577	39,190
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	206,157	193,833	17,482	16,437
	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)	9,877,402	9,566,149	790,192	765,291