

(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	
		2020年3月末	2019年12月末	2020年3月末	2019年12月末
1	信用リスク	2,696,357	3,089,023	227,310	260,628
2	うち、標準的手法適用分	0	-	0	-
3	うち、内部格付手法適用分	2,417,161	2,813,950	204,975	238,622
	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	279,195	275,073	22,335	22,005
4	カウンターパーティ信用リスク	302,087	312,007	25,023	25,883
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	90,551	100,786	7,678	8,546
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	110,178	109,014	8,814	8,721
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	13,540	10,629	1,083	850
	その他	87,816	91,577	7,446	7,765
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	1,776,041	1,967,300	150,608	166,827
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)	901,579	1,439,812	75,676	121,393
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)	719,224	715,007	60,855	60,387
	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%)	33,829	32,042	2,706	2,563
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	460,801	456,123	36,864	36,489
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	460,614	455,936	36,849	36,474
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	414,362	699,441	33,148	55,955
17	うち、標準的方式適用分	16,468	17,593	1,317	1,407
18	うち、内部モデル方式適用分	397,893	681,848	31,831	54,547
19	オペレーショナル・リスク	532,386	532,247	42,590	42,579
20	うち、基礎的手法適用分	21	30	1	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	532,364	532,217	42,589	42,577
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	187,849	206,157	15,929	17,482
	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)	8,383,920	9,877,402	670,713	790,192