

(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	
		2020年12月末	2020年9月末	2020年12月末	2020年9月末
1	信用リスク	3,243,220	3,087,491	271,502	258,448
2	うち、標準的手法適用分	214,323	179,229	17,145	14,338
3	うち、内部格付手法適用分	2,509,323	2,385,226	212,790	202,267
	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	519,573	523,035	41,565	41,842
4	カウンターパーティ信用リスク	258,085	266,610	21,295	21,980
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	58,308	55,856	4,944	4,736
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	99,460	106,182	7,956	8,494
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	23,415	24,590	1,873	1,967
	その他	76,900	79,980	6,521	6,782
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	133,197	125,149	11,295	10,612
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)	1,197,074	1,282,148	101,075	108,277
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)	828,016	734,363	66,241	58,749
	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%)	84,649	38,510	7,178	3,265
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%)	51,538	55,520	4,123	4,441
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	540,846	555,380	43,267	44,430
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	540,658	555,193	43,252	44,415
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	694,681	597,922	55,574	47,833
17	うち、標準的方式適用分	113,667	110,145	9,093	8,811
18	うち、内部モデル方式適用分	581,014	487,777	46,481	39,022
19	オペレーショナル・リスク	1,011,079	986,944	80,886	78,955
20	うち、基礎的手法適用分	403,760	403,760	32,300	32,300
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	607,319	583,184	48,585	46,654
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	120,913	125,375	10,253	10,631
	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)	8,408,666	8,095,351	672,693	647,628