

(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	3,012,042	2,878,577	254,155	242,879
2	うち、標準的手法適用分	-	-	-	-
3	うち、内部格付手法適用分	2,748,370	2,623,682	233,061	222,488
	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	263,671	254,895	21,093	20,391
4	カウンターパーティ信用リスク	249,424	245,799	20,646	20,348
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	67,420	62,383	5,717	5,290
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	93,430	90,980	7,474	7,278
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	11,654	12,119	932	969
	その他	76,919	80,316	6,522	6,810
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	2,015,627	1,846,972	170,925	156,623
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)	1,341,024	1,434,791	112,892	120,830
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)	750,233	659,919	60,018	52,793
	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%)	49,147	53,349	3,931	4,267
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	432,603	456,835	34,608	36,546
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	432,415	456,647	34,593	36,531
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	590,291	495,936	47,223	39,674
17	うち、標準的方式適用分	9,277	8,159	742	652
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	556,825	533,944	44,546	42,715
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	556,795	533,914	44,543	42,713
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	90,744	90,957	7,695	7,713
	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)	9,547,771	9,095,755	763,821	727,660