

(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	
		2021年3月末	2020年12月末	2021年3月末	2020年12月末
1	信用リスク	3,408,921	3,243,220	285,366	271,502
2	うち、標準的手法適用分	254,027	214,323	20,322	17,145
3	うち、内部格付手法適用分	2,636,044	2,509,323	223,536	212,790
	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	518,850	519,573	41,508	41,565
4	カウンターパーティ信用リスク	418,342	258,085	34,543	21,295
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	132,161	58,308	11,207	4,944
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	170,117	99,460	13,609	7,956
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	24,092	23,415	1,927	1,873
	その他	91,970	76,900	7,799	6,521
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	142,294	133,197	12,066	11,295
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)	1,707,670	1,197,074	144,276	101,075
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)	936,593	828,016	74,930	66,241
	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%)	75,752	84,649	6,423	7,178
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%)	37,834	51,538	3,026	4,123
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	549,833	540,846	43,986	43,267
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	549,645	540,658	43,971	43,252
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	596,584	694,681	47,726	55,574
17	うち、標準的方式適用分	98,729	113,667	7,898	9,093
18	うち、内部モデル方式適用分	497,854	581,014	39,828	46,481
19	オペレーショナル・リスク	1,042,299	1,011,079	83,383	80,886
20	うち、基礎的手法適用分	437,306	403,760	34,984	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	604,993	607,319	48,399	48,585
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	139,066	120,913	11,792	10,253
	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)	9,344,049	8,408,666	747,523	672,693