

(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	
		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	3,192,913	3,012,042	269,393	254,155
2	うち、標準的手法適用分	-	-	-	-
3	うち、内部格付手法適用分	2,908,442	2,748,370	246,635	233,061
	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	284,471	263,671	22,757	21,093
4	カウンターパーティ信用リスク	415,580	249,424	34,392	20,646
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	146,331	67,420	12,408	5,717
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	163,598	93,430	13,087	7,474
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	13,121	11,654	1,049	932
	その他	92,528	76,919	7,846	6,522
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	2,045,058	2,015,627	173,420	170,925
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)	1,847,415	1,341,024	155,735	112,892
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)	851,459	750,233	68,119	60,018
	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%)	35,108	49,147	2,808	3,931
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	417,570	432,603	33,405	34,608
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	417,383	432,415	33,390	34,593
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	500,189	590,291	40,015	47,223
17	うち、標準的方式適用分	2,334	9,277	186	742
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	557,069	556,825	44,565	44,546
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	557,047	556,795	44,563	44,543
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	109,503	90,744	9,285	7,695
	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)	10,469,593	9,547,771	837,567	763,821