

(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6月末	2021年3月末	2021年6月末	2021年3月末
1	信用リスク	3,324,026	3,408,921	277,986	285,366
2	うち、標準的手法適用分	256,220	254,027	20,497	20,322
3	うち、内部格付手法適用分	2,513,509	2,636,044	213,145	223,536
	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	554,296	518,850	44,343	41,508
4	カウンターパーティ信用リスク	298,986	418,342	24,595	34,543
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	74,874	132,161	6,349	11,207
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	130,552	170,117	10,444	13,609
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	27,470	24,092	2,197	1,927
	その他	66,089	91,970	5,604	7,799
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	154,974	142,294	13,141	12,066
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)	1,736,055	1,707,670	146,733	144,276
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)	1,000,924	936,593	80,076	74,930
	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%)	76,562	75,752	6,492	6,423
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%)	34,996	37,834	2,799	3,026
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	559,981	549,833	44,798	43,986
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	559,793	549,645	44,783	43,971
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	844,500	596,584	67,560	47,726
17	うち、標準的方式適用分	102,614	98,729	8,209	7,898
18	うち、内部モデル方式適用分	741,885	497,854	59,350	39,828
19	オペレーショナル・リスク	1,042,942	1,042,299	83,435	83,383
20	うち、基礎的手法適用分	437,306	437,306	34,984	34,984
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	605,636	604,993	48,450	48,399
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	126,407	139,066	10,719	11,792
	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)	9,479,252	9,344,049	758,340	747,523