

(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	3,062,536	3,192,913	258,390	269,393
2	うち、標準的手法適用分	-	-	-	-
3	うち、内部格付手法適用分	2,789,137	2,908,442	236,518	246,635
	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	273,398	284,471	21,871	22,757
4	カウンターパーティ信用リスク	271,508	415,580	22,436	34,392
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	82,951	146,331	7,034	12,408
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	105,246	163,598	8,419	13,087
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	17,118	13,121	1,369	1,049
	その他	66,192	92,528	5,613	7,846
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	2,083,774	2,045,058	176,704	173,420
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)	1,879,298	1,847,415	158,352	155,735
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)	917,202	851,459	73,378	68,119
	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%)	31,937	35,108	2,554	2,808
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	410,069	417,570	32,805	33,405
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	409,881	417,383	32,790	33,390
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	741,910	500,189	59,352	40,015
17	うち、標準的方式適用分	25	2,334	2	186
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	551,929	557,069	44,154	44,565
20	うち、基礎的手法適用分	21	21	1	1
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	551,907	557,047	44,152	44,563
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	102,335	109,503	8,678	9,285
	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)	10,541,268	10,469,593	843,301	837,567