

(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9月末	2021年6月末	2021年9月末	2021年6月末
1	信用リスク	3,350,182	3,324,026	280,223	277,986
2	うち、標準的手法適用分	228,001	256,220	18,240	20,497
3	うち、内部格付手法適用分	2,543,534	2,513,509	215,691	213,145
	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	578,646	554,296	46,291	44,343
4	カウンターパーティ信用リスク	335,414	298,986	27,687	24,595
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	86,370	74,874	7,324	6,349
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	133,040	130,552	10,643	10,444
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	24,398	27,470	1,951	2,197
	その他	91,604	66,089	7,768	5,604
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	161,134	154,974	13,664	13,141
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)	1,699,532	1,736,055	143,461	146,733
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)	1,084,332	1,000,924	86,749	80,076
	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%)	76,533	76,562	6,490	6,492
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%)	39,035	34,996	3,122	2,799
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	589,717	559,981	47,177	44,798
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	589,530	559,793	47,162	44,783
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	562,293	844,500	44,983	67,560
17	うち、標準的方式適用分	94,221	102,614	7,537	8,209
18	うち、内部モデル方式適用分	468,072	741,885	37,445	59,350
19	オペレーショナル・リスク	1,048,327	1,042,942	83,866	83,435
20	うち、基礎的手法適用分	441,914	437,306	35,353	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	606,413	605,636	48,513	48,450
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	126,633	126,407	10,738	10,719
	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)	9,352,063	9,479,252	748,165	758,340