

(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12月末	2021年9月末	2021年12月末	2021年9月末
1	信用リスク	3,349,357	3,350,182	279,699	280,223
2	うち、標準的手法適用分	301,257	228,001	24,100	18,240
3	うち、内部格付手法適用分	2,448,198	2,543,534	207,607	215,691
	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	599,900	578,646	47,992	46,291
4	カウンターパーティ信用リスク	364,623	335,414	30,152	27,687
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	91,113	86,370	7,726	7,324
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	135,008	133,040	10,800	10,643
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	24,909	24,398	1,992	1,951
	その他	113,591	91,604	9,632	7,768
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	155,181	161,134	13,159	13,664
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)	1,663,405	1,699,532	140,057	143,461
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)	1,181,037	1,084,332	94,486	86,749
	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%)	91,073	76,533	7,723	6,490
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%)	60,780	39,035	4,862	3,122
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	429,663	589,717	34,373	47,177
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	429,475	589,530	34,358	47,162
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	606,201	562,293	48,496	44,983
17	うち、標準的方式適用分	94,945	94,221	7,595	7,537
18	うち、内部モデル方式適用分	511,256	468,072	40,900	37,445
19	オペレーショナル・リスク	1,084,069	1,048,327	86,726	83,866
20	うち、基礎的手法適用分	441,914	441,914	35,353	35,353
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	642,155	606,413	51,372	48,513
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	119,922	126,633	10,169	10,738
	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)	9,373,815	9,352,063	749,905	748,165