

(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	
		2022年3月末	2021年12月末	2022年3月末	2021年12月末
1	信用リスク	3,158,131	3,349,357	263,348	279,699
2	うち、標準的手法適用分	262,693	301,257	21,015	24,100
3	うち、内部格付手法適用分	2,228,800	2,448,198	189,002	207,607
	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	666,637	599,900	53,330	47,992
4	カウンターパーティ信用リスク	592,309	364,623	48,892	30,152
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	222,923	91,113	18,903	7,726
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	257,140	135,008	20,571	10,800
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	21,128	24,909	1,690	1,992
	その他	91,117	113,591	7,726	9,632
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	146,671	155,181	12,437	13,159
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)	1,370,413	1,663,405	115,189	140,057
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)	1,349,848	1,181,037	107,991	94,486
	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%)	99,787	91,073	8,462	7,723
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%)	87,540	60,780	7,003	4,862
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	511,216	429,663	40,897	34,373
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	511,028	429,475	40,882	34,358
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	669,814	606,201	53,585	48,496
17	うち、標準的方式適用分	118,854	94,945	9,508	7,595
18	うち、内部モデル方式適用分	550,959	511,256	44,076	40,900
19	オペレーショナル・リスク	1,136,242	1,084,069	90,899	86,726
20	うち、基礎的手法適用分	492,487	441,914	39,399	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	643,756	642,155	51,500	51,372
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	110,462	119,922	9,367	10,169
	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)	9,475,913	9,373,815	758,073	749,905