

(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	
		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	2,823,496	2,993,896	237,858	252,542
2	うち、標準的手法適用分	-	-	-	-
3	うち、内部格付手法適用分	2,495,586	2,714,746	211,625	230,210
	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	327,910	279,150	26,232	22,332
4	カウンターパーティ信用リスク	602,795	349,664	49,845	29,013
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	246,403	103,101	20,895	8,743
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	254,292	117,677	20,343	9,414
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	10,692	15,293	855	1,223
	その他	91,407	113,591	7,751	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	2,216,789	2,197,780	187,983	186,371
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)	1,419,326	1,709,577	119,256	143,893
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)	1,266,261	1,103,556	101,304	88,287
	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%)	84,891	58,087	6,791	4,647
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	490,951	410,067	39,276	32,805
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	490,764	409,879	39,261	32,790
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	551,419	511,501	44,113	40,920
17	うち、標準的方式適用分	459	245	36	19
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	595,743	595,584	47,659	47,647
20	うち、基礎的手法適用分	43	60	3	5
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	595,699	595,524	47,656	47,642
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	88,211	88,921	7,480	7,540
	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)	10,625,381	10,517,400	850,030	841,392