

(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)		イ	ロ	ハ	ニ
国際様式の 該当番号		リスク・アセット		所要自己資本	
		2018年3月末	2017年3月末	2018年3月末	2017年3月末
1	信用リスク	6,488,135		547,628	
2	うち、標準的手法適用分	137,617		11,009	
3	うち、内部格付手法適用分	5,953,600		504,865	
	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	396,916		31,753	
4	カウンターパーティ信用リスク	428,905		35,357	
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	116,331		9,864	
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-		-	
	うち、CVAリスク	197,372		15,789	
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	13,876		1,110	
	その他	101,324		8,592	
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	316,984		26,880	
	複数の資産及び取引を裏付けとするエクスポージャー	-		-	
	信用リスク・アセットのみなし計算が適用されるエクスポージャー	1,897,897		160,941	
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	214,431		18,091	
13	うち、内部格付手法における外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分	162,831		13,808	
14	うち、内部格付手法における指定関数方式適用分	32,219		2,732	
15	うち、標準的手法適用分	13,371		1,069	
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	6,009		481	
16	マーケット・リスク	1,649,059		131,924	
17	うち、標準的方式適用分	63,472		5,077	
18	うち、内部モデル方式適用分	1,585,586		126,846	
19	オペレーショナル・リスク	874,196		69,935	
20	うち、基礎的手法適用分	256,645		20,531	
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	617,550		49,404	
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	147,231		12,485	
	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	164,693		13,175	
25	合計(スケールリングファクター勘案後)	12,705,252		1,016,420	