

(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	
		2018年9月末	2018年6月末	2018年9月末	2018年6月末
1	信用リスク	4,096,936	3,949,610	344,508	332,133
2	うち、標準的手法適用分	172,233	187,084	13,778	14,966
3	うち、内部格付手法適用分	3,490,410	3,367,643	295,986	285,576
	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	434,292	394,882	34,743	31,590
4	カウンターパーティ信用リスク	492,300	447,855	40,907	37,301
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	97,051	98,213	8,230	8,328
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	161,365	129,849	12,909	10,387
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	13,443	11,036	1,075	882
	その他	220,439	208,756	18,693	17,702
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	176,200	373,897	14,941	31,706
	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	2,415,430	2,187,845	204,828	185,529
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	233,280	191,398	19,499	16,070
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	174,220	157,885	14,773	13,388
14	うち、内部格付手法における指定関数方式適用分	-	-	-	-
15	うち、標準的手法適用分	49,779	27,424	3,982	2,193
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	9,280	6,088	743	487
16	マーケット・リスク	1,711,190	1,788,214	136,895	143,057
17	うち、標準的方式適用分	64,778	65,102	5,182	5,208
18	うち、内部モデル方式適用分	1,646,412	1,723,112	131,712	137,849
19	オペレーショナル・リスク	860,218	845,457	68,817	67,636
20	うち、基礎的手法適用分	283,807	256,645	22,704	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	576,411	588,811	46,112	47,104
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	151,274	149,145	12,828	12,647
	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(スケールリングファクター勘案後)	10,540,345	10,326,041	843,227	826,083