

(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12月末	2018年9月末	2018年12月末	2018年9月末
1	信用リスク	3,571,139	4,096,936	299,968	344,508
2	うち、標準的手法適用分	168,060	172,233	13,444	13,778
3	うち、内部格付手法適用分	2,974,532	3,490,410	252,240	295,986
	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	428,546	434,292	34,283	34,743
4	カウンターパーティ信用リスク	488,653	492,300	40,471	40,907
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	75,819	97,051	6,429	8,230
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	183,521	161,365	14,681	12,909
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	17,809	13,443	1,424	1,075
	その他	211,503	220,439	17,935	18,693
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	225,291	176,200	19,104	14,941
	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	1,468,278	2,415,430	124,510	204,828
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	240,986	233,280	20,090	19,499
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	168,859	174,220	14,319	14,773
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	64,306	49,779	5,144	3,982
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	7,820	9,280	626	743
16	マーケット・リスク	1,598,502	1,711,190	127,880	136,895
17	うち、標準的方式適用分	63,132	64,778	5,050	5,182
18	うち、内部モデル方式適用分	1,535,370	1,646,412	122,829	131,712
19	オペレーショナル・リスク	830,655	860,218	66,452	68,817
20	うち、基礎的手法適用分	283,807	283,807	22,704	22,704
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	546,847	576,411	43,747	46,112
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	138,594	151,274	11,752	12,828
	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)	8,877,885	10,540,345	710,230	843,227