

(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	
		2019年6月末	2019年3月末	2019年6月末	2019年3月末
1	信用リスク	3,217,046	3,657,227	271,409	308,648
2	うち、標準的手法適用分	-	-	-	-
3	うち、内部格付手法適用分	2,926,221	3,348,075	248,143	283,916
	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	290,825	309,152	23,266	24,732
4	カウンターパーティ信用リスク	284,634	304,165	23,694	25,312
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	79,108	80,971	6,708	6,866
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	83,601	89,572	6,688	7,165
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	8,556	10,646	684	851
	その他	113,368	122,975	9,613	10,428
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	482,594	448,244	40,924	38,011
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)	1,589,998	1,336,959	127,199	106,956
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(マニフェスト方式)	640,508	587,170	51,240	46,973
	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%)	-	-	-	-
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%)	54,619	55,261	4,369	4,420
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	472,977	493,103	37,838	39,448
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	472,789	492,915	37,823	39,433
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	857,970	1,236,500	68,637	98,920
17	うち、標準的方式適用分	17,562	14,594	1,405	1,167
18	うち、内部モデル方式適用分	840,408	1,221,905	67,232	97,752
19	オペレーショナル・リスク	490,331	491,909	39,226	39,352
20	うち、基礎的手法適用分	5	5	0	0
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	490,325	491,903	39,226	39,352
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	187,034	187,602	15,860	15,908
	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)	8,505,017	9,049,416	680,401	723,953