

(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)		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	6,482,017		548,210	
2	うち、標準的手法適用分	-		-	
3	うち、内部格付手法適用分	6,176,966		523,806	
	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	305,050		24,404	
4	カウンターパーティ信用リスク	408,635		33,788	
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	127,346		10,798	
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-		-	
	うち、CVAリスク	169,059		13,524	
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	10,869		869	
	その他	101,359		8,595	
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	432,332		36,661	
	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	1,946,499		165,063	
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	194,122		16,461	
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	161,715		13,713	
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	-		-	
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	187		15	
16	マーケット・リスク	1,600,024		128,001	
17	うち、標準的方式適用分	14,437		1,155	
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	507,514		40,601	
20	うち、基礎的手法適用分	11		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	507,502		40,600	
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	199,837		16,946	
	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	394,943		31,595	
25	合計(スケーリングファクター勘案後)	12,716,634		1,017,330	