

(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6月末	2018年3月末	2018年6月末	2018年3月末
1	信用リスク	3,949,610	6,488,135	332,133	547,628
2	うち、標準的手法適用分	187,084	137,617	14,966	11,009
3	うち、内部格付手法適用分	3,367,643	5,953,600	285,576	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	394,882	396,916	31,590	31,753
4	カウンターパーティ信用リスク	447,855	428,905	37,301	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	98,213	116,331	8,328	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	129,849	197,372	10,387	15,789
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	11,036	13,876	882	1,110
	その他	208,756	101,324	17,702	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	373,897	316,984	31,706	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	2,187,845	1,897,897	185,529	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	191,398	214,431	16,070	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	157,885	162,831	13,388	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	27,424	13,371	2,193	1,069
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	6,088	6,009	487	481
16	マーケット・リスク	1,788,214	1,649,059	143,057	131,924
17	うち、標準的方式適用分	65,102	63,472	5,208	5,077
18	うち、内部モデル方式適用分	1,723,112	1,585,586	137,849	126,846
19	オペレーショナル・リスク	845,457	874,196	67,636	69,935
20	うち、基礎的手法適用分	256,645	256,645	20,531	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	588,811	617,550	47,104	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	149,145	147,231	12,647	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(スケーリングファクター勘案後)	10,326,041	12,705,252	826,083	1,016,420