

(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	
		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	3,916,404	6,482,017	330,675	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	3,617,301	6,176,966	306,747	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	299,103	305,050	23,928	24,404
4	カウンターパーティ信用リスク	453,588	408,635	37,861	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	119,070	127,346	10,097	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	116,760	169,059	9,340	13,524
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	8,793	10,869	703	869
	その他	208,963	101,359	17,720	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	536,546	432,332	45,499	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	2,243,332	1,946,499	190,234	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	156,913	194,122	13,306	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	156,726	161,715	13,290	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	187	15	15
16	マーケット・リスク	1,739,249	1,600,024	139,139	128,001
17	うち、標準的方式適用分	16,136	14,437	1,290	1,155
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	519,022	507,514	41,521	40,601
20	うち、基礎的手法適用分	11	11	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	519,010	507,502	41,520	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	200,091	199,837	16,967	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)	10,190,082	12,716,634	815,206	1,017,330