

(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9月末	2018年6月末	2018年9月末	2018年6月末
1	信用リスク	4,034,938	3,916,404	340,727	330,675
2	うち、標準的手法適用分	-	-	-	-
3	うち、内部格付手法適用分	3,735,819	3,617,301	316,797	306,747
	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	299,119	299,103	23,929	23,928
4	カウンターパーティ信用リスク	483,302	453,588	40,311	37,861
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	122,132	119,070	10,356	10,097
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	130,091	116,760	10,407	9,340
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	10,000	8,793	800	703
	その他	221,077	208,963	18,747	17,720
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	376,202	536,546	31,901	45,499
	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	2,480,706	2,243,332	210,363	190,234
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	173,215	156,913	14,688	13,306
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	173,028	156,726	14,672	13,290
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	-	-	-	-
	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	1,662,995	1,739,249	133,039	139,139
17	うち、標準的方式適用分	16,583	16,136	1,326	1,290
18	うち、内部モデル方式適用分	1,646,412	1,723,112	131,712	137,849
19	オペレーショナル・リスク	508,581	519,022	40,686	41,521
20	うち、基礎的手法適用分	0	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	508,581	519,010	40,686	41,520
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	200,911	200,091	17,037	16,967
	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)	10,359,458	10,190,082	828,756	815,206