

(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12月末 | 2018年9月末 | 2018年12月末 | 2018年9月末 |
| 1 | 信用リスク | 3,518,001 | 4,034,938 | 296,904 | 340,727 |
| 2 | うち、標準的手法適用分 | - | - | - | - |
| 3 | うち、内部格付手法適用分 | 3,221,742 | 3,735,819 | 273,203 | 316,797 |
| | 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 | 296,258 | 299,119 | 23,700 | 23,929 |
| 4 | カウンターパーティ信用リスク | 399,375 | 483,302 | 33,366 | 40,311 |
| 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 | 83,593 | 122,132 | 7,088 | 10,356 |
| 6 | うち、期待エクスポージャー方式適用分 | - | - | - | - |
| | うち、CVAリスク | 93,101 | 130,091 | 7,448 | 10,407 |
| | うち、中央清算機関関連エクスポージャー | 11,163 | 10,000 | 893 | 800 |
| | その他 | 211,517 | 221,077 | 17,936 | 18,747 |
| 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 | 433,746 | 376,202 | 36,781 | 31,901 |
| | 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 | 1,568,555 | 2,480,706 | 133,013 | 210,363 |
| 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 | 167,881 | 173,215 | 14,236 | 14,688 |
| 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 | 167,693 | 173,028 | 14,220 | 14,672 |
| 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 | 1,551,558 | 1,662,995 | 124,124 | 133,039 |
| 17 | うち、標準的方式適用分 | 16,187 | 16,583 | 1,295 | 1,326 |
| 18 | うち、内部モデル方式適用分 | 1,535,370 | 1,646,412 | 122,829 | 131,712 |
| 19 | オペレーショナル・リスク | 487,412 | 508,581 | 38,992 | 40,686 |
| 20 | うち、基礎的手法適用分 | 0 | 0 | 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 | 487,412 | 508,581 | 38,992 | 40,686 |
| 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 | 182,199 | 200,911 | 15,450 | 17,037 |
| | 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) | 8,660,885 | 10,359,458 | 692,870 | 828,756 |