

(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	
		2019年3月末	2018年12月末	2019年3月末	2018年12月末
1	信用リスク	3,654,575	3,571,139	307,288	299,968
2	うち、標準的手法適用分	129,785	168,060	10,382	13,444
3	うち、内部格付手法適用分	3,108,783	2,974,532	263,624	252,240
	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	416,006	428,546	33,280	34,283
4	カウンターパーティ信用リスク	312,793	488,653	25,949	40,471
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	70,369	75,819	5,967	6,429
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	102,414	183,521	8,193	14,681
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	17,494	17,809	1,399	1,424
	その他	122,516	211,503	10,389	17,935
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	254,206	225,291	21,556	19,104
8	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算(ルック・スルー方式)	1,183,655		94,692	
9	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算(マンドート方式)	587,170		46,973	
	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算(蓋然性方式250%)	-		-	
	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算(蓋然性方式400%)	-		-	
10	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算(フォールバック方式1250%)	62,559		5,004	
	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		1,468,278		124,510
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	561,184	240,986	44,894	20,090
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	-		-	
14	うち、外部格付準拠方式適用分	560,996		44,879	
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	-		-	
	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		168,859		14,319
	うち、内部格付手法における指定関数方式適用分		-		-
	うち、標準的手法適用分		64,306		5,144
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	187	7,820	15	626
16	マーケット・リスク	1,275,521	1,598,502	102,041	127,880
17	うち、標準的方式適用分	53,616	63,132	4,289	5,050
18	うち、内部モデル方式適用分	1,221,905	1,535,370	97,752	122,829
19	オペレーショナル・リスク	808,168	830,655	64,653	66,452
20	うち、基礎的手法適用分	257,064	283,807	20,565	22,704
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	551,103	546,847	44,088	43,747
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	147,227	138,594	12,484	11,752
	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)	9,069,249	8,877,885	725,539	710,230