

(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	
		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	3,657,227	3,518,001	308,648	296,904
2	うち、標準的手法適用分	-	-	-	-
3	うち、内部格付手法適用分	3,348,075	3,221,742	283,916	273,203
	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	309,152	296,258	24,732	23,700
4	カウンターパーティ信用リスク	304,165	399,375	25,312	33,366
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	80,971	83,593	6,866	7,088
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	89,572	93,101	7,165	7,448
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	10,646	11,163	851	893
	その他	122,975	211,517	10,428	17,936
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	448,244	433,746	38,011	36,781
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)	1,336,959		106,956	
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%)	55,261		4,420	
	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		133,013
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	493,103	167,881	39,448	14,236
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	492,915		39,433	
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		167,693		14,220
	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		-		-
	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	1,236,500	1,551,558	98,920	124,124
17	うち、標準的方式適用分	14,594	16,187	1,167	1,295
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	491,909	487,412	39,352	38,992
20	うち、基礎的手法適用分	5	-	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	491,903	487,412	39,352	38,992
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	187,602	182,199	15,908	15,450
	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)	9,049,416	8,660,885	723,953	692,870