

(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9月末	2019年6月末	2019年9月末	2019年6月末
1	信用リスク	3,228,456	3,258,319	270,843	273,594
2	うち、標準的手法適用分	171,551	154,419	13,724	12,353
3	うち、内部格付手法適用分	2,618,136	2,693,504	222,018	228,409
	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	438,767	410,395	35,101	32,831
4	カウンターパーティ信用リスク	277,938	295,612	22,953	24,525
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	65,387	70,551	5,544	5,982
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	105,697	95,607	8,455	7,648
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	22,667	17,453	1,813	1,396
	その他	84,186	112,000	7,138	9,497
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	343,963	277,940	29,168	23,569
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)	1,047,062	1,420,292	88,599	113,623
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)	746,117	640,508	63,103	51,240
	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%)	39,519	62,267	3,161	4,981
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	542,679	539,748	43,414	43,179
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	542,492	539,561	43,399	43,164
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	-	-	-	-
	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	919,609	896,843	73,568	71,747
17	うち、標準的方式適用分	81,201	56,435	6,496	4,514
18	うち、内部モデル方式適用分	838,408	840,408	67,072	67,232
19	オペレーショナル・リスク	800,585	803,819	64,046	64,305
20	うち、基礎的手法適用分	253,418	257,064	20,273	20,565
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	547,167	546,754	43,773	43,740
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	170,327	148,550	14,443	12,597
	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)	8,416,297	8,542,057	673,303	683,364