

(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	3,107,274	3,217,046	262,178	271,409
2	うち、標準的手法適用分	-	-	-	-
3	うち、内部格付手法適用分	2,832,607	2,926,221	240,205	248,143
	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	274,667	290,825	21,973	23,266
4	カウンターパーティ信用リスク	260,285	284,634	21,597	23,694
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	75,413	79,108	6,395	6,708
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	86,647	83,601	6,931	6,688
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	12,152	8,556	972	684
	その他	86,072	113,368	7,298	9,613
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	1,866,047	482,594	158,240	40,924
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)	1,222,444	1,589,998	103,068	127,199
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 (マンドレート方式)	671,985	640,508	56,817	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%)	32,373	54,619	2,589	4,369
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	458,824	472,977	36,705	37,838
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	458,636	472,789	36,690	37,823
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	855,783	857,970	68,462	68,637
17	うち、標準的方式適用分	17,375	17,562	1,390	1,405
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	489,905	490,331	39,192	39,226
20	うち、基礎的手法適用分	30	5	2	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	489,875	490,325	39,190	39,226
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	193,833	187,034	16,437	15,860
	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)	9,566,149	8,505,017	765,291	680,401