

内部モデルを用いた手法と標準的手法のリスク・アセットの比較(2024年3月末)

(単位:百万円)

CMS1:内部モデルを用いた手法と標準的手法のリスク・アセットの比較(三菱UFJ銀行・連結)					
項番		イ	ロ	ハ	ニ
		リスク・アセットの額			
		内部モデルを用いて算出したリスク・アセットの額	標準的な手法適用分のリスク・アセットの額	リスク・アセットの額	資本フロア計算に用いられる、標準的な手法により算出したリスク・アセットの額(フロア掛目前)
1	信用リスク	42,842,772	19,038,822	61,881,595	117,161,040
2	カウンターパーティ信用リスク	2,256,120	2,141,112	4,397,232	7,148,935
3	CVAリスク		2,069,863	2,069,863	2,069,863
4	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	608,347	1,928,010	2,536,358	2,722,107
5	マーケット・リスク	-	1,096,148	1,096,148	1,096,148
6	オペレーショナル・リスク		5,844,570	5,844,570	5,844,570
7	その他リスク・アセット		10,007,263	10,007,263	8,387,113
8	合計	45,707,240	42,125,793	87,833,033	144,429,780