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フィナンシャル・グループ）					
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	43,606,681	22,909,435	66,516,117	124,309,931
2	カウンターパーティ信用リスク	1,607,744	5,166,301	6,774,046	9,760,668
3	CVAリスク		3,235,812	3,235,812	3,235,812
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	3,055,109	3,663,457	3,869,289
5	マーケット・リスク	-	2,513,152	2,513,152	2,513,152
6	オペレーショナル・リスク		9,141,395	9,141,395	9,141,395
7	その他リスク・アセット		19,316,193	19,316,193	18,184,185
8	合計	45,822,773	65,337,402	111,160,175	171,014,437