

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信託銀行)					
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	1,227,812	891,268	2,119,080	3,029,464
2	カウンターパーティ信用リスク	363,476	66,167	429,644	722,669
3	CVAリスク		329,562	329,562	329,562
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	-	1,127,098	1,127,098	1,127,098
5	マーケット・リスク	-	236,561	236,561	236,561
6	オペレーショナル・リスク		1,202,313	1,202,313	1,202,313
7	その他リスク・アセット		4,943,181	4,943,181	3,930,211
8	合計	1,591,288	8,796,153	10,387,442	10,577,882