

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6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	42,715,977	19,784,023	62,500,000	115,918,466
2	カウンターパーティ信用リスク	2,337,660	1,658,741	3,996,401	6,913,949
3	CVAリスク		2,331,710	2,331,710	2,331,710
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	667,060	2,003,733	2,670,794	2,856,479
5	マーケット・リスク	-	1,354,666	1,354,666	1,354,666
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		10,959,434	10,959,434	9,418,499
8	合計	45,720,698	43,936,880	89,657,578	144,638,342