

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	43,725,244	23,683,552	67,408,796	123,377,464
2	カウンターパーティ信用リスク	1,696,568	5,452,028	7,148,597	10,219,491
3	CVAリスク		3,463,285	3,463,285	3,463,285
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	3,161,914	3,828,974	4,014,659
5	マーケット・リスク	-	2,543,068	2,543,068	2,543,068
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		20,167,441	20,167,441	17,360,848
8	合計	46,088,873	67,612,686	113,701,559	170,120,214