

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                              | 1,342,704               | 753,683              | 2,096,388  | 3,014,945                                     |
| 2                                                | カウンターパーティ信用リスク                     | 375,207                 | 221,886              | 597,093    | 879,789                                       |
| 3                                                | CVAリスク                             |                         | 273,375              | 273,375    | 273,375                                       |
| 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 | -                       | 1,157,913            | 1,157,913  | 1,157,913                                     |
| 5                                                | マーケット・リスク                          | -                       | 202,657              | 202,657    | 202,657                                       |
| 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                        |                         | 4,937,254            | 4,937,254  | 3,735,787                                     |
| 8                                                | 合計                                 | 1,717,912               | 8,749,083            | 10,466,996 | 10,466,781                                    |