

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9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	39,372,551	19,539,503	58,912,054	110,756,977
2	カウンター・パーティ信用リスク	2,244,780	1,260,871	3,505,652	6,507,780
3	CVAリスク		2,107,687	2,107,687	2,107,687
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	593,802	1,899,005	2,492,808	2,650,027
5	マーケット・リスク	-	1,389,943	1,389,943	1,389,943
6	オペレーショナル・リスク		6,283,616	6,283,616	6,283,616
7	その他リスク・アセット		10,752,824	10,752,824	9,464,300
8	合計	42,211,134	43,233,452	85,444,586	139,160,333