

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	40,316,765	23,388,785	63,705,551	118,135,732
2	カウンターパーティ信用リスク	1,506,036	4,297,508	5,803,544	8,838,003
3	CVAリスク		3,187,472	3,187,472	3,187,472
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	2,881,181	3,474,984	3,632,203
5	マーケット・リスク	-	2,941,123	2,941,123	2,941,123
6	オペレーショナル・リスク		10,025,952	10,025,952	10,025,952
7	その他リスク・アセット		19,818,202	19,818,202	17,381,693
8	合計	42,416,604	66,540,225	108,956,829	164,142,181