

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	1,196,002	603,184	1,799,186	2,863,766
2	カウンターパーティ信用リスク	215,897	138,536	354,434	545,340
3	CVAリスク		234,079	234,079	234,079
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	-	981,909	981,909	981,909
5	マーケット・リスク	-	223,893	223,893	223,893
6	オペレーショナル・リスク		1,395,897	1,395,897	1,395,897
7	その他リスク・アセット		4,482,942	4,482,942	3,508,633
8	合計	1,411,900	8,060,442	9,472,343	9,753,521