

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12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	40,807,246	18,441,096	59,248,343	113,350,639
2	カウンターパーティ信用リスク	2,126,854	1,090,187	3,217,041	6,502,350
3	CVAリスク		2,066,735	2,066,735	2,066,735
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	623,097	2,124,342	2,747,440	2,833,711
5	マーケット・リスク	-	1,503,777	1,503,777	1,503,777
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		11,976,039	11,976,039	10,447,665
8	合計	43,557,198	43,485,795	87,042,993	142,988,495