

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 | 41,567,450 | 22,482,377 | 64,049,828 | 121,025,627 |
| 2 | カウンターパーティ信用リスク | 1,859,590 | 3,987,455 | 5,847,045 | 9,275,714 |
| 3 | CVAリスク | | 3,101,376 | 3,101,376 | 3,101,376 |
| 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 | 3,154,293 | 3,777,391 | 3,863,662 |
| 5 | マーケット・リスク | - | 3,540,085 | 3,540,085 | 3,540,085 |
| 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 | | 19,889,129 | 19,889,129 | 17,356,508 |
| 8 | 合計 | 44,050,138 | 66,180,670 | 110,230,808 | 168,188,927 |