

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(2025年3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	38,352,343	19,173,936	57,526,280	110,812,315
2	カウンターパーティ信用リスク	2,068,015	1,163,106	3,231,122	6,224,221
3	CVAリスク		1,775,086	1,775,086	1,775,086
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	271,110	2,506,238	2,777,349	2,910,487
5	マーケット・リスク	-	1,073,188	1,073,188	1,073,188
6	オペレーショナル・リスク		5,848,504	5,848,504	5,848,504
7	その他リスク・アセット		11,697,872	11,697,872	10,184,617
8	合計	40,691,470	43,237,933	83,929,403	138,828,421