

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	39,278,539	23,439,898	62,718,437	119,176,420
2	カウンターパーティ信用リスク	1,518,023	3,973,607	5,491,631	8,687,195
3	CVAリスク		2,901,170	2,901,170	2,901,170
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	3,534,300	3,805,410	3,938,548
5	マーケット・リスク	-	2,543,863	2,543,863	2,543,863
6	オペレーショナル・リスク		9,696,371	9,696,371	9,696,371
7	その他リスク・アセット		19,773,595	19,773,595	17,296,943
8	合計	41,067,673	65,862,807	106,930,480	164,240,514