

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	1,148,352	1,114,679	2,263,032	3,534,913
2	カウンターパーティ信用リスク	252,308	192,307	444,615	710,370
3	CVAリスク		269,818	269,818	269,818
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	-	1,027,795	1,027,795	1,027,795
5	マーケット・リスク		234,669	234,669	234,669
6	オペレーショナル・リスク		1,378,811	1,378,811	1,378,811
7	その他リスク・アセット		4,105,719	4,105,719	3,282,603
8	合計	1,400,661	8,323,801	9,724,462	10,438,981