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6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	39,631,897	19,197,568	58,829,466	110,823,989
2	カウンターパーティ信用リスク	1,877,572	1,224,850	3,102,423	6,505,833
3	CVAリスク		1,820,992	1,820,992	1,820,992
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	268,448	2,515,443	2,783,892	2,902,049
5	マーケット・リスク	-	1,401,630	1,401,630	1,401,630
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		12,032,853	12,032,853	10,264,776
8	合計	41,777,919	44,041,843	85,819,763	139,567,776