

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	40,789,132	23,444,173	64,233,305	119,044,258
2	カウンターパーティ信用リスク	1,526,706	4,116,064	5,642,770	9,061,420
3	CVAリスク		2,654,275	2,654,275	2,654,275
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	3,595,113	3,863,562	3,981,719
5	マーケット・リスク	-	2,776,288	2,776,288	2,776,288
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		19,858,622	19,858,622	17,121,934
8	合計	42,584,287	66,140,909	108,725,197	164,336,268