

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	1,297,468	1,097,506	2,394,975	3,301,400
2	カウンターパーティ信用リスク	194,575	178,789	373,364	640,538
3	CVAリスク		191,674	191,674	191,674
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	-	1,079,136	1,079,136	1,079,136
5	マーケット・リスク	-	307,430	307,430	307,430
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		4,313,509	4,313,509	3,487,815
8	合計	1,492,043	8,546,858	10,038,902	10,386,808