

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9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	40,053,511	20,276,956	60,330,468	114,826,408
2	カウンター・パーティ信用リスク	1,664,063	1,050,173	2,714,237	6,374,142
3	CVAリスク		1,798,735	1,798,735	1,798,735
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	263,127	2,680,856	2,943,984	3,061,606
5	マーケット・リスク	-	1,670,917	1,670,917	1,670,917
6	オペレーショナル・リスク		6,052,845	6,052,845	6,052,845
7	その他リスク・アセット		12,412,320	12,412,320	10,179,182
8	合計	41,980,702	45,942,807	87,923,510	143,963,838