

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12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	41,884,409	21,892,466	63,776,876	121,621,129
2	カウンターパーティ信用リスク	1,333,200	2,725,341	4,058,542	7,254,395
3	CVAリスク		1,439,447	1,439,447	1,439,447
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	280,219	3,096,317	3,376,536	3,510,864
5	マーケット・リスク	-	1,858,010	1,858,010	1,858,010
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		14,600,902	14,600,902	12,173,631
8	合計	43,497,829	51,665,332	95,163,162	153,910,325