

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	43,706,753	25,673,779	69,380,533	130,308,457
2	カウンターパーティ信用リスク	1,568,670	3,406,659	4,975,329	8,558,462
3	CVAリスク		2,552,278	2,552,278	2,552,278
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	4,050,195	4,330,414	4,464,742
5	マーケット・リスク	-	2,692,607	2,692,607	2,692,607
6	オペレーショナル・リスク		9,821,305	9,821,305	9,821,305
7	その他リスク・アセット		23,744,481	23,744,481	19,522,303
8	合計	45,555,643	71,941,306	117,496,950	177,920,156