

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	1,333,309	1,105,804	2,439,114	3,703,643
2	カウンターパーティ信用リスク	261,625	176,450	438,076	830,887
3	CVAリスク		192,718	192,718	192,718
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	-	953,342	953,342	953,342
5	マーケット・リスク	-	348,455	348,455	348,455
6	オペレーショナル・リスク		1,235,389	1,235,389	1,235,389
7	その他リスク・アセット		5,312,477	5,312,477	3,679,533
8	合計	1,594,935	9,324,638	10,919,574	10,943,970