

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(2026年3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	43,737,219	22,346,032	66,083,251	126,408,712
2	カウンターパーティ信用リスク	1,541,858	2,749,010	4,290,869	7,506,133
3	CVAリスク		1,440,531	1,440,531	1,440,531
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	332,062	3,242,957	3,575,020	3,783,970
5	マーケット・リスク	-	1,946,432	1,946,432	1,946,432
6	オペレーショナル・リスク		6,524,145	6,524,145	6,524,145
7	その他リスク・アセット		16,558,473	16,558,473	14,834,013
8	合計	45,611,140	54,807,583	100,418,724	162,443,939