

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	45,461,379	26,281,561	71,742,940	135,248,741
2	カウンターパーティ信用リスク	1,788,885	3,523,218	5,312,103	8,930,041
3	CVAリスク		2,553,512	2,553,512	2,553,512
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	4,226,171	4,558,234	4,767,185
5	マーケット・リスク	-	2,915,607	2,915,607	2,915,607
6	オペレーショナル・リスク		10,286,141	10,286,141	10,286,141
7	その他リスク・アセット		22,913,220	22,913,220	19,872,535
8	合計	47,582,327	72,699,434	120,281,761	184,573,766