

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	1,345,118	1,144,882	2,490,001	3,813,805
2	カウンターパーティ信用リスク	268,206	168,845	437,052	845,461
3	CVAリスク		186,341	186,341	186,341
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	-	982,677	982,677	982,677
5	マーケット・リスク	-	274,460	274,460	274,460
6	オペレーショナル・リスク		1,358,363	1,358,363	1,358,363
7	その他リスク・アセット		5,156,845	5,156,845	3,972,351
8	合計	1,613,324	9,272,416	10,885,741	11,433,459