

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6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	45,533,456	23,077,186	68,610,643	128,597,279
2	カウンター・パーティ信用リスク	545,467	4,105,948	4,651,415	7,979,118
3	CVAリスク		1,490,626	1,490,626	1,490,626
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	447,313	3,317,504	3,764,818	3,874,885
5	マーケット・リスク	-	2,278,202	2,278,202	2,278,202
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		16,290,672	16,290,672	14,222,631
8	合計	46,526,236	57,084,287	103,610,524	164,966,889