

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	47,331,311	27,163,005	74,494,316	137,615,374
2	カウンターパーティ信用リスク	780,788	4,752,497	5,533,286	9,267,405
3	CVAリスク		2,578,758	2,578,758	2,578,758
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	4,389,320	4,836,633	4,946,701
5	マーケット・リスク	-	3,306,760	3,306,760	3,306,760
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		23,984,811	23,984,811	20,644,639
8	合計	48,559,412	76,461,296	125,020,709	188,645,782