

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	1,438,922	1,260,546	2,699,469	3,916,228
2	カウンターパーティ信用リスク	256,138	214,488	470,627	884,432
3	CVAリスク		198,519	198,519	198,519
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	-	1,071,815	1,071,815	1,071,815
5	マーケット・リスク	-	344,477	344,477	344,477
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		5,119,719	5,119,719	3,992,441
8	合計	1,695,061	9,567,931	11,262,992	11,766,278