

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 (2024年12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	1,185,364	868,994	2,054,359	3,203,566
2	カウンターパーティ信用リスク	431,552	151,042	582,594	843,142
3	CVAリスク		288,435	288,435	288,435
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	-	1,029,684	1,029,684	1,029,684
5	マーケット・リスク	-	263,668	263,668	263,668
6	オペレーショナル・リスク		1,395,897	1,395,897	1,395,897
7	その他リスク・アセット		4,208,744	4,208,744	3,363,589
8	合計	1,616,916	8,206,467	9,823,384	10,387,985