

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(2025年9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	41,274,608	24,522,441	65,797,050	123,180,743
2	カウンターパーティ信用リスク	1,564,790	3,714,128	5,278,919	8,694,198
3	CVAリスク		2,560,568	2,560,568	2,560,568
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	263,127	3,620,768	3,883,896	4,001,518
5	マーケット・リスク	-	2,750,356	2,750,356	2,750,356
6	オペレーショナル・リスク		9,821,305	9,821,305	9,821,305
7	その他リスク・アセット		20,715,933	20,715,933	17,546,108
8	合計	43,102,526	67,705,503	110,808,030	168,554,798