（ 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 ）

イ ロ ハ ニ

内部モデルを用いて 算

出したリス ク・アセットの額

2(•GcG{G00£'ìFû#ÝFÔG

2 カウンターパーティ信用リスク 1,696,568

GMGŠGGŠGTG1 ™#ÝGxGGG=

1,696,68 GMŠ_T1 ™#ÝGx=