

2025年5月8日
株式会社 千葉銀行

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3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					
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	4,854,301	322,748	5,177,050	9,886,192
2	カウンターパーティ信用リスク	22,428	4,782	27,211	47,188
3	CVAリスク		68,338	68,338	68,338
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	－	－	－	－
5	マーケット・リスク	－	78,667	78,667	78,667
6	オペレーショナル・リスク		242,729	242,729	242,729
7	その他リスク・アセット		1,555,265	1,555,265	874,317
8	合計	4,876,730	2,272,532	7,149,263	11,197,434