

2025年8月4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					
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	4,874,726	341,830	5,216,556	9,955,897
2	カウンターパーティ信用リスク	24,721	4,198	28,920	48,135
3	CVAリスク		69,050	69,050	69,050
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	-	76,809	76,809	76,809
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		1,588,070	1,588,070	874,855
8	合計	4,899,448	2,322,689	7,222,137	11,267,479