

2025年11月7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					
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	4,930,807	367,145	5,297,952	10,248,719
2	カウンターパーティ信用リスク	21,939	4,709	26,649	42,644
3	CVAリスク		70,915	70,915	70,915
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	-	89,164	89,164	89,164
6	オペレーショナル・リスク		252,539	252,539	252,539
7	その他リスク・アセット		1,601,437	1,601,437	882,218
8	合計	4,952,746	2,385,912	7,338,658	11,586,203