

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                                 | 内部モデルを用いて算出したリスク・アセットの額            | イ                    | ロ          | ハ          | ニ   |
|                                    |                                    | 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 | 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                                  | オペレーションナル・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                                    |