2026年2月10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12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	5,019,790	380,383	5,400,174	10,498,364
2	カウンターパーティ信用リスク	20,009	4,974	24,984	39,375
3	CVAリスク		71,441	71,441	71,441
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	－	92,003	92,003	92,003
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		1,711,535	1,711,535	953,302
8	合計	5,039,800	2,512,877	7,552,677	11,907,026