2026年11月9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（2026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	5,187,337	457,562	5,644,900	11,194,095
2	カウンターパーティ信用リスク	20,704	10,819	31,523	44,484
3	CVAリスク		84,377	84,377	84,377
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	－	44,842	44,842	44,842
6	オペレーショナル・リスク		296,391	296,391	296,391
7	その他リスク・アセット		1,619,444	1,619,444	1,024,557
8	合計	5,208,042	2,513,437	7,721,480	12,688,749