

2023年8月10日

株式会社しずおかフィナンシャルグループ

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（2023年6月末）

【連結】

(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	4,087,266	127,476	4,214,742	8,098,845
2	カウンターパーティ信用リスク	42,481	646	43,127	87,381
3	CVAリスク		163,774	163,774	168,305
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	-	82,422	82,422	82,422
5	マーケット・リスク	-	488	488	488
6	オペレーショナル・リスク		175,111	175,111	175,111
7	その他リスク・アセット		818,200	818,200	492,552
8	合計	4,129,747	1,368,120	5,497,868	9,105,106

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（2023年6月末）

【連結】

（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	4,099,470	7,816	4,107,287	8,021,836
2	カウンターパーティ信用リスク	42,483	646	43,130	87,382
3	CVAリスク		163,775	163,775	168,306
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	-	82,422	82,422	82,422
5	マーケット・リスク	-	529	529	529
6	オペレーショナル・リスク		171,834	171,834	171,834
7	その他リスク・アセット		755,089	755,089	421,897
8	合計	4,141,954	1,182,113	5,324,068	8,954,208