

2023年11月27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9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	4,005,190	128,054	4,133,245	8,059,671
2	カウンターパーティ信用リスク	41,940	1,297	43,237	87,339
3	CVAリスク		169,184	169,184	173,302
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	-	81,344	81,344	81,344
5	マーケット・リスク	-	1,641	1,641	1,641
6	オペレーショナル・リスク		181,855	181,855	181,855
7	その他リスク・アセット		860,667	860,667	495,489
8	合計	4,047,131	1,424,045	5,471,176	9,080,644

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9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	4,016,685	7,910	4,024,595	7,982,202
2	カウンターパーティ信用リスク	41,940	1,297	43,237	87,339
3	CVAリスク		169,184	169,184	173,302
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	-	81,344	81,344	81,344
5	マーケット・リスク	-	1,601	1,601	1,601
6	オペレーショナル・リスク		177,783	177,783	177,783
7	その他リスク・アセット		802,706	802,706	429,934
8	合計	4,058,626	1,241,827	5,300,454	8,933,507