

2026年2月17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（2025年12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	3,956,612	757,818	4,714,430	9,401,566
2	カウンターパーティ信用リスク	34,001	1,990	35,991	71,413
3	CVAリスク		117,531	117,531	121,299
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	-	79,680	79,680	79,680
5	マーケット・リスク	-	1,995	1,995	1,995
6	オペレーショナル・リスク		216,484	216,484	216,484
7	その他リスク・アセット		1,169,238	1,169,238	835,403
8	合計	3,990,613	2,344,738	6,335,352	10,727,842

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）

【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	3,908,905	748,599	4,657,505	9,343,116
2	カウンターパーティ信用リスク	34,001	1,990	35,991	71,413
3	CVAリスク		117,531	117,531	121,299
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	-	79,680	79,680	79,680
5	マーケット・リスク	-	1,980	1,980	1,980
6	オペレーショナル・リスク		198,505	198,505	198,505
7	その他リスク・アセット		1,079,667	1,079,667	737,245
8	合計	3,942,906	2,227,955	6,170,862	10,553,241