2020年11月13日
株式会社山口銀行（単体）

リスク・アセットの概要

（平成26年金融庁告示第7号、附則別紙様式第四号第一面）　（単位：百万円）

OV1：リスク・アセットの概要

国際様式の該当番号		リスク・アセット		所要自己資本	
		2020年9月末	2020年6月末	2020年9月末	2020年6月末
1	信用リスク	1,966,423	1,951,717	166,516	165,253
2	うち、標準的手法適用分	5,202	8,363	416	669
3	うち、内部格付手法適用分	1,898,952	1,879,939	161,119	159,511
	うち、重要な出資のエクスポージャー	–	–	–	–
	うち、リース取引における見積残存価額のエクスポージャー	–	–	–	–
	その他	62,267	63,414	4,981	5,073
4	カウンターパーティー信用リスク	54,466	85,442	4,538	7,165
5	うち、SA－CCR適用分	–	–	–	–
	うち、カレント・エクスポージャー方式適用分	14,382	13,779	1,219	1,168
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	–	–	–	–
	うち、CVAリスク	16,363	16,362	1,309	1,309
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	294	293	23	23
	その他	23,426	55,007	1,986	4,664
7	マーケット・ベース方式に基づく株式等エクスポージャー	21,357	50,916	1,811	4,317
8	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算（ルック・スルー方式）	359,798	501,942	28,733	40,094
9	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算（マンデート方式）	6,967	6,084	291	293
	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算（蓋然性方式250%）	–	–	–	–
	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算（蓋然性方式400%）	–	–	–	–
10	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算（フォールバック方式1250%）	1,091	1,937	–	–
11	未決済取引	–	–	–	–
12	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	4,140	3,028	331	242
13	うち、内部格付準拠方式又は内部評価方式適用分	–	–	–	–
14	うち、外部格付準拠方式適用分	4,140	3,028	331	242
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	–	0	–	0
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	–	–	–	–
16	マーケット・リスク	–	–	–	–
17	うち、標準的方式適用分	–	–	–	–
18	うち、内部モデル方式適用分	–	–	–	–
19	オペレーショナル・リスク	90,871	90,019	7,269	7,201
20	うち、基礎的手法適用分	–	–	–	–
21	うち、粗利益配分手法適用分	90,871	90,019	7,269	7,201
22	うち、先進的計測手法適用分	–	–	–	–
23	特定項目のうち、調整項目に算入されない部分に係るエクスポージャー	32,421	35,069	2,749	2,973
	経過措置によりリスク・アセットの額に算入されるものの額	–	–	–	–
24	フロア調整	–	–	–	–
25	合計	2,537,538	2,726,158	212,241	227,542

（注）内部格付手法が適用される資産については、リスク・アセットの額はスケーリング・ファクター（1.06）を乗じる前の額を記載し、所要自己資本の額はスケーリング・ファクター（1.06）を乗じて得たリスク・アセットの額に8%を乗じて得た額を記載しております。