2026年2月20日
株式会社山口銀行（単体）

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

（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	1,827,945	125,562	1,953,508	3,259,991
2	カウンターパーティ信用リスク	19,808	657	20,466	25,849
3	CVAリスク		33,173	33,173	36,696
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	―	7,411	7,411	7,411
5	マーケット・リスク	―	―	―	―
6	オペレーショナル・リスク		75,106	75,106	75,106
7	その他リスク・アセット		760,293	760,293	431,759
8	合計	1,847,754	1,002,205	2,849,959	3,836,815