2026年2月20日
株式会社山口フィナンシャルグループ（連結）

内部モデルを用いた手法と標準的手法の連結リスク・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	3,357,765	222,741	3,580,506	6,126,662
2	カウンターパーティ信用リスク	26,603	2,160	28,763	36,987
3	CVAリスク		41,737	41,737	50,176
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	14,092	11,178	25,270	39,272
5	マーケット・リスク	―	―	―	―
6	オペレーショナル・リスク		145,693	145,693	145,693
7	その他リスク・アセット		1,184,654	1,184,654	676,125
8	合計	3,398,460	1,608,165	5,006,626	7,074,918