2026年5月22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	1,811,599	144,943	1,956,542	3,250,695
2	カウンターパーティ信用リスク	21,992	454	22,446	27,578
3	CVAリスク		38,417	38,417	43,310
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	―	6,919	6,919	6,919
5	マーケット・リスク	―	―	―	―
6	オペレーショナル・リスク		83,341	83,341	83,341
7	その他リスク・アセット		762,740	762,740	497,707
8	合計	1,833,591	1,036,816	2,870,408	3,909,552