2026年5月22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	3,341,796	250,174	3,591,970	6,150,523
2	カウンターパーティ信用リスク	27,579	2,131	29,711	38,511
3	CVAリスク		42,746	42,746	52,266
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	13,873	11,532	25,406	38,980
5	マーケット・リスク	―	―	―	―
6	オペレーショナル・リスク		165,267	165,267	165,267
7	その他リスク・アセット		1,148,168	1,148,168	761,052
8	合計	3,383,249	1,620,021	5,003,270	7,206,601