2026年8月21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	3,311,345	263,508	3,574,853	6,162,820
2	カウンターパーティ信用リスク	23,271	1,902	25,173	37,106
3	CVAリスク		33,586	33,586	43,379
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	13,393	14,531	27,924	41,232
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		1,308,245	1,308,245	855,336
8	合計	3,348,009	1,787,041	5,135,051	7,305,143