2026年8月21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	1,793,669	141,242	1,934,911	3,248,714
2	カウンターパーティ信用リスク	17,967	470	18,438	25,515
3	CVAリスク		30,184	30,184	33,052
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	―	7,634	7,634	7,634
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		899,671	899,671	580,929
8	合計	1,811,636	1,162,543	2,974,180	3,979,187