

(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 2024年6月期)

【株式会社いぎんホールディングス（連結）】

(単位：百万円)

CMS 1：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					
		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	3,290,599	14,248	3,304,848	5,329,571
2	カウンターパーティ信用リスク	23,633	358	23,992	65,614
3	CVAリスク		36,910	36,910	37,369
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	—	163	163	163
5	マーケット・リスク	—	864,566	864,566	864,566
6	オペレーショナル・リスク		156,879	156,879	156,879
7	その他リスク・アセット		718,500	718,500	351,428
8	合計	3,314,233	1,791,628	5,105,861	6,805,591

【株式会社伊予銀行（連結）】

(単位：百万円)

CMS 1：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					
		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	3,298,640	—	3,298,640	5,302,594
2	カウンターパーティ信用リスク	23,633	358	23,992	65,614
3	CVAリスク		36,910	36,910	37,369
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	—	163	163	163
5	マーケット・リスク	—	864,462	864,462	864,462
6	オペレーショナル・リスク		148,064	148,064	148,064
7	その他リスク・アセット		632,488	632,488	330,010
8	合計	3,322,274	1,682,448	5,004,722	6,748,278