

(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9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	3,212,878	15,901	3,228,779	5,214,111
2	カウンターパーティ信用リスク	45,896	357	46,253	64,212
3	CVAリスク		48,486	48,486	48,848
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	—	141	141	141
5	マーケット・リスク	—	816,447	816,447	816,447
6	オペレーショナル・リスク		173,632	173,632	173,632
7	その他リスク・アセット		804,397	804,397	427,608
8	合計	3,258,774	1,859,364	5,118,139	6,745,003

【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	3,222,862	0	3,222,862	5,190,483
2	カウンターパーティ信用リスク	45,896	357	46,253	64,212
3	CVAリスク		48,486	48,486	48,848
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	—	141	141	141
5	マーケット・リスク	—	816,355	816,355	816,355
6	オペレーショナル・リスク		164,487	164,487	164,487
7	その他リスク・アセット		711,113	711,113	403,737
8	合計	3,268,758	1,740,941	5,009,700	6,688,266