

(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12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	3,300,346	16,099	3,316,446	5,296,141
2	カウンターパーティ信用リスク	46,120	407	46,527	63,442
3	CVAリスク		32,024	32,024	33,590
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	—	130	130	130
5	マーケット・リスク	—	581,262	581,262	581,262
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		848,728	848,728	478,984
8	合計	3,346,466	1,652,285	4,998,752	6,627,185

【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	3,310,208	0	3,310,208	5,308,579
2	カウンターパーティ信用リスク	46,120	407	46,527	63,442
3	CVAリスク		32,024	32,024	33,590
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	—	130	130	130
5	マーケット・リスク	—	581,159	581,159	581,159
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		748,950	748,950	417,280
8	合計	3,356,328	1,527,158	4,883,487	6,568,670