

(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 2025年3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	3,006,972	314,972	3,321,945	5,363,412
2	カウンターパーティ信用リスク	49,792	387	50,179	63,109
3	CVAリスク		34,604	34,604	35,624
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	—	109	109	109
5	マーケット・リスク	—	568,345	568,345	568,345
6	オペレーショナル・リスク		189,089	189,089	189,089
7	その他リスク・アセット		828,329	828,329	528,823
8	合計	3,056,765	1,935,837	4,992,603	6,748,515

【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	3,019,649	298,240	3,317,890	5,381,956
2	カウンターパーティ信用リスク	49,792	387	50,179	63,109
3	CVAリスク		34,604	34,604	35,624
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	—	109	109	109
5	マーケット・リスク	—	568,232	568,232	568,232
6	オペレーショナル・リスク		179,965	179,965	179,965
7	その他リスク・アセット		737,047	737,047	463,445
8	合計	3,069,442	1,818,585	4,888,028	6,692,443