

(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	2,956,487	301,814	3,258,301	5,320,888
2	カウンターパーティ信用リスク	52,502	635	53,137	70,622
3	CVAリスク		38,652	38,652	39,363
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	—	92	92	92
5	マーケット・リスク	—	536,466	536,466	536,466
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		733,304	733,304	488,053
8	合計	3,008,989	1,800,055	4,809,045	6,644,577

【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	2,970,430	282,412	3,252,842	5,342,736
2	カウンターパーティ信用リスク	52,502	635	53,137	70,622
3	CVAリスク		38,652	38,652	39,363
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	—	92	92	92
5	マーケット・リスク	—	536,333	536,333	536,333
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		641,560	641,560	421,108
8	合計	3,022,933	1,679,651	4,702,584	6,590,223