

(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	3,087,269	293,619	3,380,889	5,459,657
2	カウンターパーティ信用リスク	48,029	641	48,671	68,061
3	CVAリスク		38,806	38,806	39,341
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	—	—	—	—
5	マーケット・リスク	—	599,017	599,017	599,017
6	オペレーショナル・リスク		211,909	211,909	211,909
7	その他リスク・アセット		770,347	770,347	507,091
8	合計	3,135,299	1,914,341	5,049,640	6,885,077

【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	3,102,264	274,885	3,377,149	5,485,364
2	カウンターパーティ信用リスク	48,029	641	48,671	68,061
3	CVAリスク		38,806	38,806	39,341
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	—	—	—	—
5	マーケット・リスク	—	598,922	598,922	598,922
6	オペレーショナル・リスク		202,654	202,654	202,654
7	その他リスク・アセット		673,933	673,933	435,087
8	合計	3,150,294	1,789,843	4,940,138	6,829,431