

(内部格付手法を適用した信用リスク・エクスポージャーのリスク・アセット変動表 2023年12月期)

【株式会社いよぎんホールディングス (連結)】

(単位：百万円)

項番		信用リスク・アセットの額	
1	前四半期末時点における信用リスク・アセットの額	3,593,930	
2	当四半期中の 要因別の変動 額	資産の規模	△ 7,295
3		ポートフォリオの質	10,964
4		モデルの更新	—
5		手法及び方針	—
6		買収又は売却	—
7		為替の変動	△ 7,106
8		その他	—
9	当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	3,590,493	

(注) 要因別の変動額の計算方法は以下の通りであります。なお、EADは原通貨建の金額であります。
 資産の規模：(当四半期末EAD－前四半期末EAD) × 前四半期末為替レート × 前四半期末平均リスク・ウェイト
 ポートフォリオの質：当四半期末EAD × 当四半期末為替レート × (当四半期末平均リスク・ウェイト－前四半期末平均リスク・ウェイト)
 為替の変動：当四半期末EAD × (当四半期末為替レート－前四半期末為替レート) × 前四半期末平均リスク・ウェイト

【株式会社伊予銀行 (連結)】

(単位：百万円)

項番		信用リスク・アセットの額	
1	前四半期末時点における信用リスク・アセットの額	3,598,650	
2	当四半期中の 要因別の変動 額	資産の規模	△ 7,135
3		ポートフォリオの質	10,854
4		モデルの更新	—
5		手法及び方針	—
6		買収又は売却	—
7		為替の変動	△ 7,106
8		その他	—
9	当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	3,595,263	

(注) 要因別の変動額の計算方法は以下の通りであります。なお、EADは原通貨建の金額であります。
 資産の規模：(当四半期末EAD－前四半期末EAD) × 前四半期末為替レート × 前四半期末平均リスク・ウェイト
 ポートフォリオの質：当四半期末EAD × 当四半期末為替レート × (当四半期末平均リスク・ウェイト－前四半期末平均リスク・ウェイト)
 為替の変動：当四半期末EAD × (当四半期末為替レート－前四半期末為替レート) × 前四半期末平均リスク・ウェイト