

(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 2024年3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		3,590,493
2	当四半期中の 要因別の変動 額	資産の規模	74,816
3		ポートフォリオの質	38,829
4		モデルの更新	—
5		手法及び方針	△ 566,396
6		買収又は売却	—
7		為替の変動	23,600
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	

(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
 バーゼルⅢ最終化適用に伴う信用リスク・アセットの変動について、「手法及び方針」の項に計上しております。

【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		3,595,263
2	当四半期中の 要因別の変動 額	資産の規模	75,959
3		ポートフォリオの質	41,686
4		モデルの更新	—
5		手法及び方針	△ 567,910
6		買収又は売却	—
7		為替の変動	23,600
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	

(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
 バーゼルⅢ最終化適用に伴う信用リスク・アセットの変動について、「手法及び方針」の項に計上しております。