

(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)

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	3,129,373	305,127	3,434,500	5,632,014
2	カウンターパーティ信用リスク	43,757	620	44,377	58,643
3	CVAリスク		33,925	33,925	34,816
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	—	371,340	371,340	371,340
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		826,333	826,333	527,634
8	合計	3,173,130	1,749,257	4,922,387	6,836,359

【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	3,146,107	284,138	3,430,246	5,660,775
2	カウンターパーティ信用リスク	43,757	620	44,377	58,643
3	CVAリスク		33,925	33,925	34,816
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	—	371,263	371,263	371,263
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		726,660	726,660	454,876
8	合計	3,189,865	1,619,263	4,809,128	6,783,031