

(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 2026年6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	3,150,193	378,185	3,528,378	5,726,892
2	カウンターパーティ信用リスク	32,899	445	33,344	45,858
3	CVAリスク		25,085	25,085	26,050
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	—	382,850	382,850	382,850
6	オペレーショナル・リスク		156,124	156,124	156,124
7	その他リスク・アセット		863,364	863,364	593,813
8	合計	3,183,092	1,806,055	4,989,148	6,931,590

【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	3,170,804	352,812	3,523,617	5,758,200
2	カウンターパーティ信用リスク	32,899	445	33,344	45,858
3	CVAリスク		25,085	25,085	26,050
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	—	382,828	382,828	382,828
6	オペレーショナル・リスク		142,846	142,846	142,846
7	その他リスク・アセット		761,157	761,157	512,352
8	合計	3,203,704	1,665,175	4,868,879	6,868,137