

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（2018年6月末）

（単位：百万円）

CR8: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			
項番		信用リスク・アセットの額	
1	前期末(2018年3月末)時点における信用リスク・アセットの額	4,780,145	
2	当期中の 要因別の 変動額	資産の規模	40,620
3		ポートフォリオの質	△37,615
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	9,190
8	その他	—	
9	当期末(2018年6月末)時点における信用リスク・アセットの額	4,792,341	

（注）当期中の要因別の変動額の計算方法は以下の通りであります。

資産の規模：(当期末 EAD－前期末 EAD)×前期末加重平均リスク・ウエイト×前期末為替レート

ポートフォリオの質：当期末 EAD×(当期末加重平均リスク・ウエイト－前期末加重平均リスク・ウエイト)×当期末為替レート

為替の変動：当期末 EAD×前期末加重平均リスク・ウエイト×(当期末為替レート－前期末為替レート)

なお、EAD は原通貨額ベースの EAD であります。