

(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月期（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 |           | 3,019,876    |
| 2  | 当四半期中<br>の要因別の<br>変動額   | 資産の規模     | 65,974       |
| 3  |                         | ポートフォリオの質 | △ 38,187     |
| 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     | 7,221        |
| 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 |           | 3,054,884    |

(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