

(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)

【2020年9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		3,235,976
2	当四半期中 の要因別の 変動額	資産の規模	53,022
3		ポートフォリオの質	2,999
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	△ 1,472
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