

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）

【連結】

（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 | 前四半期末時点における信用リスク・アセットの額 | 3,974,341 | |
| 2 | 当四半期中 の要因別の 変動額 | 資産の規模 | ▲ 8,404 |
| 3 | | ポートフォリオの質 | +46,157 |
| 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 | - |
| 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 | 4,012,094 | |

- (注1) カウンターパーティ信用リスク、証券化取引に係る信用リスク、信用リスク・アセットのみなし計算に係る信用リスク、マーケット・ベース方式が適用される株式等に係る信用リスク、内部格付手法におけるその他資産等に係る信用リスク、特定項目のうち調整項目に算入されない部分に係る信用リスクは本表の対象外としております。
- (注2) 「資産の規模」の項には、貸出金の実行や回収等によるエクスポージャーの増減に起因する信用リスク・アセットの額の変動額を記載しております。なお、当行は貸出金全体に占める外貨貸出金の割合が小さいため、為替の変動によるエクスポージャーの増減に起因する変動額も本項に含めております。
- (注3) 「ポートフォリオの質」の項には、個々の取引先の格付ランク、債権のプール区分及び残存期間等の変動や、リスク特性の異なるエクスポージャー区分間の構成の変動に起因する信用リスク・アセットの額の変動額を記載しております。