

連結リスク・アセット変動表(2018年6月末)

(別紙様式第八号) 第二面

(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	3,126,386	
2	当四半期中 の要因別の 変動額	資産の規模	△ 17,678
3		ポートフォリオの質	△ 61,489
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	2,879
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	3,050,096	

(別紙様式第八号) 第三面

CCR7: 期待エクスポージャー方式を用いたカウンターパーティ信用リスク・エクスポージャーのリスク・アセット変動表
与信相当額の算出に当たり期待エクスポージャー方式を用いていないため作成していません。

(別紙様式第八号) 第四面

MR2: 内部モデル方式を適用して算出されたリスク・アセットの額の変動要因
マーケット・リスク相当額不算入の特例を適用しており、該当がないため作成していません。