

# 連結リスク・アセット変動表 (2020年9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 |           | 3,087,520    |
| 2                                         | 当四半期中<br>の要因別の<br>変動額   | 資産の規模     | 9,913        |
| 3                                         |                         | ポートフォリオの質 | 1,758        |
| 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     | △ 1,380      |
| 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 |           | 3,097,811    |

(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おりません。

(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おりません。