

連結リスク・アセット変動表
(2021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・エクスポートジャーヤーのリスク・アセット変動表

項目番号	内部格付手法を適用した信用リスク・エクスポートジャーヤーのリスク・アセット変動表		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		3,032,642
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	7,347
3		ポートフォリオの質	△ 31,680
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	908
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		3,009,218

(別紙様式第八号 第三面)

CCR7：期待エクスポートジャーヤー方式を用いたカウンターパーティ信用リスク・エクスポートジャーヤーのリスク・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トジャーヤ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。