

## 連結リスク・アセット変動表 (2022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	3,016,724
2	当四半期中 の要因別の 変動額	資産の規模
3		△ 17,839
4		ポートフォリオの質
5		△ 103,439
6		モデルの更新
7		-
8		手法及び方針
9		-
10	買収又は売却	
11	-	
12	為替の変動	
13	9,944	
14	その他	
15	-	
16	当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	2,905,390

(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。