

連結リスク・アセット変動表 (2023年3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	2,853,844	
2	当四半期中 の要因別の 変動額	資産の規模	86,892
3		ポートフォリオの質	△ 4,782
4		モデルの更新	-
5		手法及び方針	△ 429,704
6		買収又は売却	-
7		為替の変動	570
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	2,506,820	

項番5「手法及び方針」には、2023年3月末より新規制（自己資本比率告示の改正：令和4年金融庁告示第22号）を適用したこと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。

(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。

(別紙様式第八号 第五面)

CVA4：CVAリスク・エクスポージャーのリスク・アセット変動表

CVAリスク相当額の算出に当たりSA-CVAを用いていないため作成しておりません。