

連結リスク・アセット変動表 (2023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	2,506,820	
2	当四半期中 の要因別の 変動額	資産の規模	45,296
3		ポートフォリオの質	△ 3,092
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	9,067
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	2,558,092	

(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：内部モデル方式によるマーケット・リスク相当額に関する内訳

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。