

**連結リスク・アセット変動表  
(2024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・エクスポートのリスク・アセット変動表

項目番号	項目説明	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	2,454,195
2	資産の規模	98,714
3	ポートフォリオの質	△ 14,893
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	8,237
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	2,546,253

(別紙様式第八号 第三面)

CCR7：期待エクスポート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・エクスポートのリスク・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。