Reg. 23.105 (I)
Appendix
B

SCHEDULE 3 – PORTFOLIO SUMMARY OF DERIVATIVES EXPOSURES BY INTERNAL CREDIT RATING

Items on this page to be reported by: Swap Dealers (Authorized to use models)
Major Swap Participants

Internal Credit Rating		Gross Replacement Value Receivable		Gross Replacement Value Payable		Net Replacement Value		Current Net Exposure		Current Net and Potential Exposure		Margin Collected
1.	12349	$ 12386	$ 12423	$ 12460	$ 12497	$ 12534	$ 12572
2.	12350	$ 12387	$ 12424	$ 12461	$ 12498	$ 12535	$ 12573
3.	12351	$ 12388	$ 12425	$ 12462	$ 12499	$ 12536	$ 12574
4.	12352	$ 12389	$ 12426	$ 12463	$ 12500	$ 12537	$ 12575
5.	12353	$ 12390	$ 12427	$ 12464	$ 12501	$ 12538	$ 12576
6.	12354	$ 12391	$ 12428	$ 12465	$ 12502	$ 12539	$ 12577
7.	12355	$ 12392	$ 12429	$ 12466	$ 12503	$ 12540	$ 12578
8.	12356	$ 12393	$ 12430	$ 12467	$ 12504	$ 12541	$ 12579
9.	12357	$ 12394	$ 12431	$ 12468	$ 12505	$ 12542	$ 12580
10.	12358	$ 12395	$ 12432	$ 12469	$ 12506	$ 12543	$ 12581
11.	12359	$ 12396	$ 12433	$ 12470	$ 12507	$ 12544	$ 12582
12.	12360	$ 12397	$ 12434	$ 12471	$ 12508	$ 12545	$ 12583
13.	12361	$ 12398	$ 12435	$ 12472	$ 12509	$ 12546	$ 12584
14.	12362	$ 12399	$ 12436	$ 12473	$ 12510	$ 12547	$ 12585
15.	12363	$ 12400	$ 12437	$ 12474	$ 12511	$ 12548	$ 12586
16.	12364	$ 12401	$ 12438	$ 12475	$ 12512	$ 12549	$ 12587
17.	12365	$ 12402	$ 12439	$ 12476	$ 12513	$ 12550	$ 12588
18.	12366	$ 12403	$ 12440	$ 12477	$ 12514	$ 12551	$ 12589
19.	12367	$ 12404	$ 12441	$ 12478	$ 12515	$ 12552	$ 12590
20.	12368	$ 12405	$ 12442	$ 12479	$ 12516	$ 12553	$ 12591
21.	12369	$ 12406	$ 12443	$ 12480	$ 12517	$ 12554	$ 12592
22.	12370	$ 12407	$ 12444	$ 12481	$ 12518	$ 12555	$ 12593
23.	12371	$ 12408	$ 12445	$ 12482	$ 12519	$ 12556	$ 12594
24.	12372	$ 12409	$ 12446	$ 12483	$ 12520	$ 12557	$ 12595
25.	12373	$ 12410	$ 12447	$ 12484	$ 12521	$ 12558	$ 12596
26.	12374	$ 12411	$ 12448	$ 12485	$ 12522	$ 12559	$ 12597
27.	12375	$ 12412	$ 12449	$ 12486	$ 12523	$ 12560	$ 12598
28.	12376	$ 12413	$ 12450	$ 12487	$ 12524	$ 12561	$ 12599
29.	12377	$ 12414	$ 12451	$ 12488	$ 12525	$ 12562	$ 12600
30.	12378	$ 12415	$ 12452	$ 12489	$ 12526	$ 12563	$ 12601
31.	12379	$ 12416	$ 12453	$ 12490	$ 12527	$ 12564	$ 12602
32.	12380	$ 12417	$ 12454	$ 12491	$ 12528	$ 12565	$ 12603
33.	12381	$ 12418	$ 12455	$ 12492	$ 12529	$ 12566	$ 12604
34.	12382	$ 12419	$ 12456	$ 12493	$ 12530	$ 12567	$ 12605
35.	12383	$ 12420	$ 12457	$ 12494	$ 12531	$ 12568	$ 12606
36.	12384	$ 12421	$ 12458	$ 12495	$ 12532	$ 12569	$ 12607
Unrated	12385	$ 12422	$ 12459	$ 12496	$ 12533	$ 12570	$ 12608
Totals:		$ 7822	$ 7823	$ 7821	$ 7820	$ 12571	$ 12609

Name of firm: _____
As of: _____

NOTE: The information required to be reported within this form is intended to be identical to that required to be reported by Security Based Swap Dealers and Major Security Based Swap Participants under SEC FORM X-17a-5 FOCUS Report Part II. Please refer to FOCUS REPORT II INSTRUCTIONS and related interpretations published by the SEC in the preparation of this form.