

自己資本比率の算式における分母の額に関する開示事項(2019年3月末・連結)

(単位:百万円)

OV1:リスク・アセットの概要					
国際様式の 該当番号		イ	ロ	ハ	ニ
		リスク・アセット		所要自己資本	
		2019年3月末	2018年12月末	2019年3月末	2018年12月末
1	信用リスク	5,900,202	5,441,133	499,034	460,038
2	うち、標準的手法適用分	135,360	143,292	10,828	11,463
3	うち、内部格付手法適用分	5,628,859	5,155,807	477,327	437,212
	うち、重要な出資のエクスポージャー	-	-	-	-
	うち、リース取引における見積残存価額のエクスポージャー	-	-	-	-
	その他	135,982	142,034	10,878	11,362
4	カウンターパーティ信用リスク	526,744	553,464	43,164	45,586
5	うち、SA-CGR適用分	54,677	-	4,636	-
	うち、カレント・エクスポージャー方式適用分	-	84,944	-	7,203
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	74,451	109,720	5,956	8,777
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	238,684	171,017	19,094	13,681
	その他	158,930	187,781	13,477	15,923
7	マーケット・ベース方式に基づく株式等エクスポージャー	1,703,602	1,560,822	144,465	132,357
8	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算(ルック・スルー方式)	25,580,900	-	2,168,668	-
9	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算(マンドート方式)	1,054,709	-	89,439	-
	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算(蓋然性方式250%)	-	-	-	-
	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算(蓋然性方式400%)	112,342	-	9,526	-
10	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算(フォールバック方式1250%)	1,098,813	-	87,905	-
	複数の資産及び取引を裏付けとするエクスポージャー	-	-	-	-
	信用リスク・アセットのみなし計算が適用されるエクスポージャー	-	25,045,862	-	2,123,861
11	未決済取引	6,364	15,625	539	1,325
12	信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャー	2,159,835	706,698	172,786	59,928
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	-	-	-	-
14	うち、外部格付準拠方式適用分	2,159,835	-	172,786	-
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	-	-	-	-
	うち、内部格付手法における外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分	-	706,698	-	59,928
	うち、内部格付手法における指定関数方式適用分	-	-	-	-
	うち、標準的手法適用分	-	-	-	-
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	0	0	0	0
16	マーケット・リスク	2,370,494	1,545,357	189,639	123,628
17	うち、標準的方式適用分	2,352,803	1,529,065	188,224	122,325
18	うち、内部モデル方式適用分	17,690	16,292	1,415	1,303
19	オペレーショナル・リスク	572,760	709,217	45,820	56,737
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
21	うち、粗利益配分手法適用分	572,760	709,217	45,820	56,737
22	うち、先進的計測手法適用分	-	-	-	-
23	特定項目のうち、調整項目に算入されない部分に係るエクスポージャー	59,258	58,915	5,025	4,996
	経過措置によりリスク・アセットの額に算入されるものの額	-	-	-	-
24	フロア調整	-	-	-	-
25	合計	41,146,027	35,637,098	3,456,016	3,008,458

自己資本比率の算式における分母の額に関する開示事項(2019年3月末・連結)

(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	5,155,807	
2	当四半期中 の要因別の 変動額	資産の規模	553,498
3		ポートフォリオの質	△ 81,532
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	1,086
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	5,628,859	

自己資本比率の算式における分母の額に関する開示事項(2019年3月末・連結)

(単位:百万円)

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			
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	当四半期中の 要因別の変動 額	資産の規模	-
3		取引相手方の信用力	-
4		モデルの更新(期待エクスポージャー方式に係る変動のみ)	-
5		手法及び方針(期待エクスポージャー方式に係る変動のみ)	-
6		買収又は売却	-
7		為替の変動	-
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	-

注:当金庫は2019年3月末時点において、期待エクスポージャー方式の適用はありません。

自己資本比率の算式における分母の額に関する開示事項(2019年3月末・連結)

(単位:百万円)

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							
項番		イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ
		バリュエーション・リスク	ストレステスト・バリュエーション・リスク	追加的リスク	包括的リスク	その他	合計
1a	前四半期末におけるリスク・アセット	3,303	12,988	-	-		16,292
1b	前四半期末における自己資本比率規制上のリスク・アセット額への調整	2.67	2.59	-	-		2.60
1c	前四半期末の算出前基準日における内部モデル方式の算出額	1,236	5,014	-	-		6,251
2	当四半期中の要因別の変動額	リスク量の変動	△ 239	△ 391	-	-	△ 630
3		モデルの更新又は変更	-	-	-	-	-
4		手法及び方針	-	-	-	-	-
5		買収及び売却	-	-	-	-	-
6		為替の変動	0	3	-	-	4
7		その他	△ 272	-	-	-	△ 272
8a		当四半期末の算出基準日における内部モデル方式の算出額	725	4,626	-	-	
8b	当四半期末における自己資本比率規制上のリスク・アセット額への調整	4.54	3.11	-	-		3.30
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	3,297	14,392	-	-		17,690