

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9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9月末	2019年6月末	2019年9月末	2019年6月末
1	信用リスク	6,303,084	6,138,523	532,955	519,099
2	うち、標準的手法適用分	204,248	167,874	16,339	13,429
3	うち、内部格付手法適用分	5,981,018	5,836,915	507,190	494,970
	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	117,817	133,734	9,425	10,698
4	カウンターパーティ信用リスク	487,033	525,924	39,994	43,091
5	うち、SA-CCR適用分	56,236	53,034	4,768	4,497
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	82,105	76,451	6,568	6,116
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	189,974	237,423	15,197	18,993
	その他	158,717	159,014	13,459	13,484
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	3,717,764	3,697,783	315,266	313,572
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)	22,774,187	22,051,984	1,930,925	1,869,823
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)	149	581,045	12	49,272
	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%)	304,175	65,463	25,794	5,551
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%)	988,078	861,333	79,046	68,906
11	未決済取引	549	25,752	46	2,183
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	2,139,222	2,196,689	171,137	175,735
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	2,139,222	2,196,689	171,137	175,735
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	-	-	-	-
	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	3,278,818	2,966,925	262,305	237,354
17	うち、標準的方式適用分	3,267,899	2,952,704	261,431	236,216
18	うち、内部モデル方式適用分	10,919	14,220	873	1,137
19	オペレーショナル・リスク	572,760	572,760	45,820	45,820
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	572,760	45,820	45,820
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	59,111	58,596	5,012	4,968
	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	40,624,936	39,742,782	3,408,317	3,335,379

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9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	5,836,915	
2	当四半期中 の要因別の 変動額	資産の規模	286,574
3		ポートフォリオの質	△ 122,300
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	△ 20,171
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	5,981,018	

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9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9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9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・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	2,385	11,835	-	-		14,220
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	3.51	5.83	-	-		5.25
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	677	2,027	-	-		2,705
2	当四半期中の要因別の変動額	リスク量の変動	39	1,212	-	-	1,251
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	△1	△2	-	-	△4
7		その他	181	-	-	-	181
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	897	3,237	-	-	
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	2.67	2.63	-	-		2.64
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	2,401	8,517	-	-		10,919