

## 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(2020年12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	
		2020年12月末	2020年9月末	2020年12月末	2020年9月末
1	信用リスク	8,603,876	8,626,761	728,883	730,869
2	うち、標準的手法適用分	20,418	17,658	1,633	1,412
3	うち、内部格付手法適用分	8,452,860	8,485,110	716,802	719,537
	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	130,596	123,992	10,447	9,919
4	カウンターパーティ信用リスク	532,068	428,025	43,659	35,341
5	うち、SA-CCR適用分	79,437	66,456	6,736	5,635
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	81,449	70,354	6,515	5,628
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	222,800	128,620	17,824	10,289
	その他	148,380	162,594	12,582	13,787
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	3,677,150	3,666,469	311,822	310,916
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)	18,371,964	17,859,306	1,557,843	1,514,366
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)	-	-	-	-
	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%)	237,849	185,744	20,169	15,751
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%)	473,117	509,577	37,849	40,766
11	未決済取引	147,268	149,339	12,488	12,664
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	1,971,849	2,002,677	157,747	160,214
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	1,971,849	2,002,677	157,747	160,214
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	4,232,238	4,070,238	338,579	325,619
17	うち、標準的方式適用分	4,229,121	4,067,472	338,329	325,397
18	うち、内部モデル方式適用分	3,116	2,765	249	221
19	オペレーショナル・リスク	502,551	502,551	40,204	40,204
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
21	うち、粗利益配分手法適用分	502,551	502,551	40,204	40,204
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	62,728	60,983	5,319	5,171
	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	38,812,664	38,061,675	3,254,566	3,191,884

## 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(2020年12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	8,485,110	
2	当四半期中 の要因別の 変動額	資産の規模	91,946
3		ポートフォリオの質	△ 137,181
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	12,985
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	8,452,860	

## 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(2020年12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2020年12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(2020年12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・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	921	1,844	-	-		2,765
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	6.98	4.77	-	-		5.34
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	131	385	-	-		517
2	当四半期中の要因別の変動額	リスク量の変動	165	308	-	-	474
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	△ 2	△ 1	-	-	△ 4
7		その他	△ 44	-	-	-	△ 44
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	249	692	-	-	
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	3.74	3.14	-	-		3.30
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	936	2,180	-	-		3,116