

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(2021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	
		2021年9月末	2021年6月末	2021年9月末	2021年6月末
1	信用リスク	8,360,940	9,076,520	707,882	768,656
2	うち、標準的手法適用分	67,648	48,616	5,411	3,889
3	うち、内部格付手法適用分	8,126,611	8,861,359	689,136	751,443
	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	166,679	166,543	13,334	13,323
4	カウンターパーティ信用リスク	500,020	540,351	40,814	44,140
5	うち、SA-CCR適用分	58,546	88,286	4,964	7,486
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	65,817	93,699	5,265	7,495
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	264,754	256,642	21,180	20,531
	その他	110,901	101,722	9,404	8,626
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	3,498,826	3,694,744	296,700	313,314
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)	17,157,382	16,534,991	1,454,890	1,402,080
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%)	160,555	194,726	13,615	16,512
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%)	581,461	421,120	46,516	33,689
11	未決済取引	157,683	156,510	13,371	13,272
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	1,419,194	1,548,577	113,535	123,886
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	1,419,194	1,548,577	113,535	123,886
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	3,967,819	4,021,218	317,425	321,697
17	うち、標準的方式適用分	3,962,793	4,016,439	317,023	321,315
18	うち、内部モデル方式適用分	5,026	4,779	402	382
19	オペレーショナル・リスク	687,106	687,106	54,968	54,968
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
21	うち、粗利益配分手法適用分	687,106	687,106	54,968	54,968
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	64,252	62,785	5,448	5,324
	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	36,555,243	36,938,655	3,065,170	3,097,542

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(2021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	8,861,359	
2	当四半期中 の要因別の 変動額	資産の規模	△ 655,931
3		ポートフォリオの質	△ 144,870
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	66,053
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	8,126,611	

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(2021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2021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(2021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・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	1,446	3,332	-	-		4,779
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	3.60	3.97	-	-		3.85
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	401	837	-	-		1,239
2	当四半期中の要因別の 変動額	リスク量の変動	74	714	-	-	789
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	△ 5	-	-	△ 7
7		その他	15	-	-	-	15
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	490	1,545	-	-	
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	3.49	2.14	-	-		2.46
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	1,712	3,313	-	-		5,026