

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(平成30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	
		平成30年12月末	平成30年9月末	平成30年12月末	平成30年9月末
1	信用リスク	5,441,133	5,411,955	460,038	457,773
2	うち、標準的手法適用分	143,292	110,665	11,463	8,853
3	うち、内部格付手法適用分	5,155,807	5,170,299	437,212	438,441
	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	142,034	130,991	11,362	10,479
4	カウンターパーティ信用リスク	553,464	455,659	45,586	37,536
5	うち、SA-CCR適用分	-	-	-	-
	うち、カレント・エクスポージャー方式適用分	84,944	39,775	7,203	3,372
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	109,720	58,031	8,777	4,642
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	171,017	171,806	13,681	13,744
	その他	187,781	186,046	15,923	15,776
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	1,560,822	1,701,161	132,357	144,258
	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	25,599,464	2,123,861	2,170,806
11	未決済取引	15,625	-	1,325	-
12	信用リスク・アセットの額の対象となっている証券化エクスポージャー	706,698	654,444	59,928	55,496
13	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	654,444	59,928	55,496
14	うち、内部格付手法における指定関数方式適用分	-	-	-	-
15	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	1,545,357	1,569,780	123,628	125,582
17	うち、標準的方式適用分	1,529,065	1,532,522	122,325	122,601
18	うち、内部モデル方式適用分	16,292	37,257	1,303	2,980
19	オペレーショナル・リスク	709,217	709,217	56,737	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	709,217	709,217	56,737	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	58,915	58,591	4,996	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	35,637,098	36,160,274	3,008,458	3,053,160

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(平成30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	5,170,299	
2	当四半期中 の要因別の 変動額	資産の規模	115,608
3		ポートフォリオの質	△ 88,115
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	△ 41,984
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	5,155,807	

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(平成30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:当金庫は平成30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(平成30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		イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ
項番		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	6,113	31,143	-	-		37,257
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	12.01	11.08	-	-		11.22
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	509	2,808	-	-		3,317
2	当四半期中の要因別の変動額	リスク量の変動	464	2,303	-	-	2,768
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	△ 20	△ 97	-	-	△ 118
7		その他	283	-	-	-	283
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	1,236	5,014	-	-	
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	2.59	-	-		2.60
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	3,303	12,988	-	-		16,292