

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6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6月末	2019年3月末	2019年6月末	2019年3月末
1	信用リスク	6,138,523	5,900,202	519,099	499,034
2	うち、標準的手法適用分	167,874	135,360	13,429	10,828
3	うち、内部格付手法適用分	5,836,915	5,628,859	494,970	477,327
	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	133,734	135,982	10,698	10,878
4	カウンターパーティ信用リスク	525,924	526,744	43,091	43,164
5	うち、SA-CCR適用分	53,034	54,677	4,497	4,636
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	76,451	74,451	6,116	5,956
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	237,423	238,684	18,993	19,094
	その他	159,014	158,930	13,484	13,477
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	3,697,783	1,703,602	313,572	144,465
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)	22,051,984	25,580,900	1,869,823	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)	581,045	1,054,709	49,272	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%)	65,463	112,342	5,551	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%)	861,333	1,098,813	68,906	87,905
11	未決済取引	25,752	6,364	2,183	539
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	2,196,689	2,159,835	175,735	172,786
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	2,196,689	2,159,835	175,735	172,786
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	2,966,925	2,370,494	237,354	189,639
17	うち、標準的方式適用分	2,952,704	2,352,803	236,216	188,224
18	うち、内部モデル方式適用分	14,220	17,690	1,137	1,415
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	58,596	59,258	4,968	5,025
	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	39,742,782	41,146,027	3,335,379	3,456,016

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6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	5,628,859	
2	当四半期中 の要因別の 変動額	資産の規模	323,405
3		ポートフォリオの質	△ 71,439
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	△ 43,909
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	5,836,915	

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6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6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6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	3,297	14,392	-	-		17,690
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	4.54	3.11	-	-		3.30
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	725	4,626	-	-		5,352
2	当四半期中の要因別の変動額	リスク量の変動	△174	△2,589	-	-	△2,763
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	△8	-	-	△11
7		その他	128	-	-	-	128
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	677	2,027	-	-	
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	3.51	5.83	-	-		5.25
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	2,385	11,835	-	-		14,220