

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	
		2019年12月末	2019年9月末	2019年12月末	2019年9月末
1	信用リスク	6,748,376	6,303,084	570,384	532,955
2	うち、標準的手法適用分	234,763	204,248	18,781	16,339
3	うち、内部格付手法適用分	6,357,255	5,981,018	539,095	507,190
	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	156,357	117,817	12,508	9,425
4	カウンターパーティ信用リスク	406,469	487,033	33,539	39,994
5	うち、SA-CCR適用分	53,044	56,236	4,498	4,768
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	76,400	82,105	6,112	6,568
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	117,061	189,974	9,364	15,197
	その他	159,962	158,717	13,564	13,459
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	3,745,771	3,717,764	317,641	315,266
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)	21,641,651	22,774,187	1,834,893	1,930,925
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	-	12
	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%)	309,844	304,175	26,274	25,794
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%)	900,869	988,078	72,069	79,046
11	未決済取引	122,599	549	10,396	46
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	2,158,756	2,139,222	172,700	171,137
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	2,158,756	2,139,222	172,700	171,137
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	3,286,807	3,278,818	262,944	262,305
17	うち、標準的方式適用分	3,275,191	3,267,899	262,015	261,431
18	うち、内部モデル方式適用分	11,616	10,919	929	873
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	61,165	59,111	5,186	5,012
	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	39,955,070	40,624,936	3,351,853	3,408,317

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	5,981,018	
2	当四半期中 の要因別の 変動額	資産の規模	432,966
3		ポートフォリオの質	△ 103,226
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	46,497
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	6,357,255	

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2019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(2019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	3,303	12,988	-	-		16,292
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	2.67	2.59	-	-		2.60
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	1,236	5,014	-	-		6,251
2	当四半期中の要因別の変動額	リスク量の変動	-239	-391	-	-	-630
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	-	3	-	-	4
7		その他	-272	-	-	-	-272
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	725	4,626	-	-	
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	4.54	3.11	-	-		3.30
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	3,297	14,392	-	-		17,690