

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	
		2020年6月末	2020年3月末	2020年6月末	2020年3月末
1	信用リスク	8,425,633	7,819,278	713,821	662,279
2	うち、標準的手法適用分	17,891	39,176	1,431	3,134
3	うち、内部格付手法適用分	8,285,522	7,653,521	702,612	649,018
	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	122,219	126,580	9,777	10,126
4	カウンターパーティ信用リスク	393,693	502,124	32,581	41,605
5	うち、SA-CCR適用分	63,541	112,547	5,388	9,544
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	67,134	111,084	5,370	8,886
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	100,294	91,998	8,023	7,359
	その他	162,721	186,494	13,798	15,814
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	3,790,958	3,674,767	321,473	311,620
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)	18,008,133	16,921,993	1,526,990	1,434,891
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%)	174,315	254,263	14,781	21,561
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%)	578,223	589,350	46,257	47,148
11	未決済取引	150,921	151,616	12,798	12,857
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	2,027,730	2,062,865	162,218	165,029
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	2,027,730	2,062,865	162,218	165,029
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	3,967,626	3,065,346	317,410	245,227
17	うち、標準的方式適用分	3,966,700	3,051,409	317,336	244,112
18	うち、内部モデル方式適用分	926	13,937	74	1,114
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	60,499	60,973	5,130	5,170
	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	38,080,286	35,605,132	3,193,667	2,987,594

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	7,653,521	
2	当四半期中 の要因別の 変動額	資産の規模	642,240
3		ポートフォリオの質	△ 33,392
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	23,153
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	8,285,522	

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2020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(2020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・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	5,160	8,776	-	-		13,937
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	28.44	69.20	-	-		45.21
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	181	126	-	-		308
2	当四半期中の要因別の 変動額	リスク量の変動	202	264	-	-	467
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	-	-	-	-	-
7		その他	△ 204	-	-	-	△ 204
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	179	391	-	-	
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	2.08	1.41	-	-		1.62
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	374	551	-	-		926