

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	
		2020年9月末	2020年6月末	2020年9月末	2020年6月末
1	信用リスク	8,626,761	8,425,633	730,869	713,821
2	うち、標準的手法適用分	17,658	17,891	1,412	1,431
3	うち、内部格付手法適用分	8,485,110	8,285,522	719,537	702,612
	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	123,992	122,219	9,919	9,777
4	カウンターパーティ信用リスク	428,025	393,693	35,341	32,581
5	うち、SA-CCR適用分	66,456	63,541	5,635	5,388
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	70,354	67,134	5,628	5,370
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	128,620	100,294	10,289	8,023
	その他	162,594	162,721	13,787	13,798
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	3,666,469	3,790,958	310,916	321,473
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)	17,859,306	18,008,133	1,514,366	1,526,990
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%)	185,744	174,315	15,751	14,781
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%)	509,577	578,223	40,766	46,257
11	未決済取引	149,339	150,921	12,664	12,798
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	2,002,677	2,027,730	160,214	162,218
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	2,002,677	2,027,730	160,214	162,218
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	4,070,238	3,967,626	325,619	317,410
17	うち、標準的方式適用分	4,067,472	3,966,700	325,397	317,336
18	うち、内部モデル方式適用分	2,765	926	221	74
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	60,983	60,499	5,171	5,130
	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	38,061,675	38,080,286	3,191,884	3,193,667

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	8,285,522	
2	当四半期中 の要因別の 変動額	資産の規模	259,996
3		ポートフォリオの質	△ 66,481
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	6,073
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	8,485,110	

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2020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(2020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	374	551	-	-		926
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	2.08	1.41	-	-		1.62
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	179	391	-	-		570
2	当四半期中の要因別の変動額	リスク量の変動	-2	-5	-	-	-8
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	-45	-	-	-	-45
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	131	385	-	-	
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	6.98	4.77	-	-		5.34
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	921	1,844	-	-		2,765