

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(2021年3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	
		2021年3月末	2020年12月末	2021年3月末	2020年12月末
1	信用リスク	8,889,579	8,603,876	752,878	728,883
2	うち、標準的手法適用分	33,791	20,418	2,703	1,633
3	うち、内部格付手法適用分	8,690,040	8,452,860	736,915	716,802
	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	165,747	130,596	13,259	10,447
4	カウンターパーティ信用リスク	516,251	532,068	42,156	43,659
5	うち、SA-CCR適用分	56,728	79,437	4,810	6,736
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	63,383	81,449	5,070	6,515
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	274,412	222,800	21,952	17,824
	その他	121,727	148,380	10,322	12,582
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	3,956,159	3,677,150	335,482	311,822
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)	17,453,738	18,371,964	1,479,982	1,557,843
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%)	155,062	237,849	13,149	20,169
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%)	419,324	473,117	33,545	37,849
11	未決済取引	156,294	147,268	13,253	12,488
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	1,895,836	1,971,849	151,666	157,747
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	1,895,836	1,971,849	151,666	157,747
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	3,592,396	4,232,238	287,391	338,579
17	うち、標準的方式適用分	3,586,009	4,229,121	286,880	338,329
18	うち、内部モデル方式適用分	6,386	3,116	510	249
19	オペレーショナル・リスク	687,106	502,551	54,968	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	687,106	502,551	54,968	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	62,716	62,728	5,318	5,319
	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	37,784,467	38,812,664	3,169,794	3,254,566

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(2021年3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	8,452,860	
2	当四半期中 の要因別の 変動額	資産の規模	151,349
3		ポートフォリオの質	△ 89,148
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	174,979
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	8,690,040	

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(2021年3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2021年3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(2021年3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	936	2,180	-	-		3,116
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	3.74	3.14	-	-		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	249	692	-	-		942
2	当四半期中の要因別の変動額	リスク量の変動	436	529	-	-	965
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	15	13	-	-	29
7		その他	△ 240	-	-	-	△ 240
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	460	1,235	-	-	
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	4.32	3.55	-	-		3.76
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	1,994	4,391	-	-		6,386