

## 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(2022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	
		2022年3月末	2021年12月末	2022年3月末	2021年12月末
1	信用リスク	8,503,594	8,401,125	719,616	711,166
2	うち、標準的手法適用分	159,087	87,500	12,727	7,000
3	うち、内部格付手法適用分	8,193,628	8,141,018	694,819	690,358
	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	150,877	172,605	12,070	13,808
4	カウンターパーティ信用リスク	701,047	493,373	57,324	40,278
5	うち、SA-CCR適用分	117,866	59,788	9,995	5,070
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	119,115	66,643	9,529	5,331
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	323,522	258,332	25,881	20,666
	その他	140,543	108,610	11,918	9,210
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	3,865,629	3,667,396	327,805	310,995
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)	18,033,078	17,543,100	1,529,162	1,487,604
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%)	158,723	201,082	13,459	17,051
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%)	500,006	531,297	40,000	42,503
11	未決済取引	163,354	161,435	13,852	13,689
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	1,549,274	1,428,466	123,941	114,277
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	1,549,274	1,428,466	123,941	114,277
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	2,942,611	4,265,431	235,408	341,234
17	うち、標準的方式適用分	2,937,924	4,258,381	235,033	340,670
18	うち、内部モデル方式適用分	4,686	7,049	374	563
19	オペレーショナル・リスク	836,435	687,106	66,914	54,968
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
21	うち、粗利益配分手法適用分	836,435	687,106	66,914	54,968
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	65,970	65,497	5,594	5,554
	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	37,319,723	37,445,312	3,133,081	3,139,324

## 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(2022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	8,141,018	
2	当四半期中 の要因別の 変動額	資産の規模	82,658
3		ポートフォリオの質	△ 223,463
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	193,415
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	8,193,628	

## 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(2022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2022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(2022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	2,633	4,416	-	-		7,049
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	11.11	4.13	-	-		5.40
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	236	1,067	-	-		1,304
2	当四半期中の要因別の変動額	リスク量の変動	-215	-961	-	-	-1,176
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	0	0	-	-	0
7		その他	78	-	-	-	78
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	100	106	-	-	
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	17.82	27.07	-	-		22.58
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	1,795	2,890	-	-		4,686