

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	
		2022年12月末	2022年9月末	2022年12月末	2022年9月末
1	信用リスク	9,470,611	9,420,539	801,223	797,221
2	うち、標準的手法適用分	253,826	206,158	20,306	16,492
3	うち、内部格付手法適用分	9,078,109	9,078,835	769,823	769,885
	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	138,675	135,545	11,094	10,843
4	カウンターパーティ信用リスク	557,143	590,422	45,541	48,147
5	うち、SA-CCR適用分	124,983	80,364	10,598	6,814
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	116,688	79,506	9,335	6,360
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	238,404	320,585	19,072	25,646
	その他	77,067	109,967	6,535	9,325
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	3,681,447	4,095,276	312,186	347,279
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(レック・スルー方式)	15,291,444	18,010,746	1,296,654	1,527,239
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%)	173,478	176,735	14,710	14,987
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%)	910,555	887,904	72,844	71,032
11	未決済取引	-	158,373	-	13,430
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	1,840,736	1,890,780	147,258	151,262
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	1,840,736	1,890,780	147,258	151,262
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	1,338,398	1,780,902	107,071	142,472
17	うち、標準的方式適用分	1,327,089	1,776,640	106,167	142,131
18	うち、内部モデル方式適用分	11,308	4,261	904	340
19	オペレーショナル・リスク	836,435	836,435	66,914	66,914
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	836,435	66,914	66,914
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	1,380,015	1,329,086	117,025	112,706
	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	35,480,267	39,177,203	2,981,433	3,292,693

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	9,078,835	
2	当四半期中 の要因別の 変動額	資産の規模	337,218
3		ポートフォリオの質	△ 116,200
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	△ 221,742
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	9,078,109	

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2022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(2022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	1,780	2,481	-	-		4,261
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	2.73	1.80	-	-		2.10
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	650	1,371	-	-		2,022
2	当四半期中の要因別の 変動額	リスク量の変動	424	1,066	-	-	1,491
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	△ 6	0	-	-	△ 6
7		その他	2,098	-	-	-	2,098
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	3,166	2,438	-	-	
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	1.32	2.91	-	-		2.01
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	4,206	7,101	-	-		11,308