

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(平成30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	
		平成30年9月末	平成30年6月末	平成30年9月末	平成30年6月末
1	信用リスク	5,411,955	5,249,712	457,773	443,991
2	うち、標準的手法適用分	110,665	114,858	8,853	9,188
3	うち、内部格付手法適用分	5,170,299	5,003,122	438,441	424,264
	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	130,991	131,731	10,479	10,538
4	カウンターパーティ信用リスク	455,659	436,340	37,536	35,961
5	うち、SA-CCR適用分	-	-	-	-
	うち、カレント・エクスポージャー方式適用分	39,775	38,326	3,372	3,250
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	58,031	55,469	4,642	4,437
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	171,806	161,229	13,744	12,898
	その他	186,046	181,315	15,776	15,375
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	1,701,161	1,579,842	144,258	133,970
	複数の資産及び取引を裏付けとするエクスポージャー	-	-	-	-
	信用リスク・アセットのみなし計算が適用されるエクスポージャー	25,599,464	23,497,213	2,170,806	1,992,541
11	未決済取引	-	-	-	-
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	654,444	576,103	55,496	48,853
13	うち、内部格付手法における外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分	654,444	576,103	55,496	48,853
14	うち、内部格付手法における指定関数方式適用分	-	-	-	-
15	うち、標準的手法適用分	-	-	-	-
	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	1,569,780	1,395,589	125,582	111,647
17	うち、標準的方式適用分	1,532,522	1,358,000	122,601	108,640
18	うち、内部モデル方式適用分	37,257	37,589	2,980	3,007
19	オペレーショナル・リスク	709,217	709,217	56,737	56,737
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
21	うち、粗利益配分手法適用分	709,217	709,217	56,737	56,737
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	58,591	57,774	4,968	4,899
	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	36,160,274	33,501,793	3,053,160	2,828,603

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(平成30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	5,003,122	
2	当四半期中 の要因別の 変動額	資産の規模	426,225
3		ポートフォリオの質	△ 184,805
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	28,143
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	5,170,299	

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(平成30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:当金庫は平成30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(平成30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 バリュエーション・リスク	ロ ストレス・バリュエーション・リスク	ハ 追加的リスク	ニ 包括的リスク	ホ その他	ヘ 合計
1a	前四半期末におけるリスク・アセット	7,126	30,462	-	-		37,589
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	2.34	2.82	-	-		2.71
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	3,040	10,796	-	-		13,837
2	当四半期中の要因別の 変動額	リスク量の変動	△ 753	△ 8,031	-	-	△ 8,784
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	1	43	-	-	45
7	その他	3	-	-	-	-	3
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	509	2,808	-	-		3,317
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	12.01	11.08	-	-		11.22
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	6,113	31,143	-	-		37,257