

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6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6月末	平成30年3月末	平成30年6月末	平成30年3月末
1	信用リスク	5,249,712	5,115,398	443,991	432,755
2	うち、標準的手法適用分	114,858	71,423	9,188	5,713
3	うち、内部格付手法適用分	5,003,122	4,900,735	424,264	415,582
	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	131,731	143,239	10,538	11,459
4	カウンターパーティ信用リスク	436,340	478,053	35,961	39,309
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	38,326	42,302	3,250	3,587
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	55,469	64,705	4,437	5,176
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	161,229	191,435	12,898	15,314
	その他	181,315	179,609	15,375	15,230
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	1,579,842	1,587,104	133,970	134,586
	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	23,497,213	22,365,018	1,992,541	1,896,529
11	未決済取引	-	0	-	0
12	信用リスク・アセットの額の対象となっている証券化エクスポージャー	576,103	518,665	48,853	43,982
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	576,103	518,665	48,853	43,982
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	1,395,589	1,197,002	111,647	95,760
17	うち、標準的方式適用分	1,358,000	1,171,398	108,640	93,711
18	うち、内部モデル方式適用分	37,589	25,604	3,007	2,048
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	57,774	60,904	4,899	5,164
	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	33,501,793	32,031,365	2,828,603	2,704,826

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6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	4,900,736	
2	当四半期中 の要因別の 変動額	資産の規模	173,027
3		ポートフォリオの質	△ 95,395
4		モデルの更新	0
5		手法及び方針	0
6		買収又は売却	0
7		為替の変動	24,754
8		その他	0
9	当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	5,003,122	

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6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6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6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	4,236	21,367	-	-		25,604
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	5.01	2.50	-	-		2.72
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	845	8,535	-	-		9,380
2	当四半期中の要因別の 変動額	リスク量の変動	1,140	2,276	-	-	3,416
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	38	△ 15	-	-	22
7	その他	1,017	-	-	-	-	1,017
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	3,040	10,796	-	-		13,837
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	2.34	2.82	-	-		2.71
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	7,126	30,462	-	-		37,589