

## 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(2020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	
		2020年3月末	2019年12月末	2020年3月末	2019年12月末
1	信用リスク	7,819,278	6,748,376	662,279	570,384
2	うち、標準的手法適用分	39,176	234,763	3,134	18,781
3	うち、内部格付手法適用分	7,653,521	6,357,255	649,018	539,095
	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	126,580	156,357	10,126	12,508
4	カウンターパーティ信用リスク	502,124	406,469	41,605	33,539
5	うち、SA-CCR適用分	112,547	53,044	9,544	4,498
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	111,084	76,400	8,886	6,112
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	91,998	117,061	7,359	9,364
	その他	186,494	159,962	15,814	13,564
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	3,674,767	3,745,771	311,620	317,641
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)	16,921,993	21,641,651	1,434,891	1,834,893
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%)	254,263	309,844	21,561	26,274
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%)	589,350	900,869	47,148	72,069
11	未決済取引	151,616	122,599	12,857	10,396
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	2,062,865	2,158,756	165,029	172,700
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	2,062,865	2,158,756	165,029	172,700
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	3,065,346	3,286,807	245,227	262,944
17	うち、標準的方式適用分	3,051,409	3,275,191	244,112	262,015
18	うち、内部モデル方式適用分	13,937	11,616	1,114	929
19	オペレーショナル・リスク	502,551	572,760	40,204	45,820
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
21	うち、粗利益配分手法適用分	502,551	572,760	40,204	45,820
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	60,973	61,165	5,170	5,186
	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	35,605,132	39,955,070	2,987,594	3,351,853

## 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(2020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	6,357,255	
2	当四半期中 の要因別の 変動額	資産の規模	351,492
3		ポートフォリオの質	△ 314,155
4		モデルの更新	-
5		手法及び方針	1,323,157
6		買収又は売却	-
7		為替の変動	△ 64,229
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	7,653,521	

注:手法及び方針の変動は、バーゼルⅢ規制見直しの最終化の一部内容を早期適用したことに伴い、計算法の一部を変更したことが要因です。

## 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(2020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2020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(2020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		イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ
項番		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	2,454	9,161	-	-		11,616
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	2.81	3.04	-	-		2.98
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	873	3,012	-	-		3,885
2	当四半期中の要因別の変動額	リスク量の変動	△ 826	△ 2,885	-	-	△ 3,711
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	-	-	-	-	-
7	その他	134	-	-	-	-	134
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	181	126	-	-		308
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	28.44	69.20	-	-		45.21
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	5,160	8,776	-	-		13,937