

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(2021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	
		2021年6月末	2021年3月末	2021年6月末	2021年3月末
1	信用リスク	9,076,520	8,889,579	768,656	752,878
2	うち、標準的手法適用分	48,616	33,791	3,889	2,703
3	うち、内部格付手法適用分	8,861,359	8,690,040	751,443	736,915
	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	166,543	165,747	13,323	13,259
4	カウンターパーティ信用リスク	540,351	516,251	44,140	42,156
5	うち、SA-CCR適用分	88,286	56,728	7,486	4,810
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	93,699	63,383	7,495	5,070
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	256,642	274,412	20,531	21,952
	その他	101,722	121,727	8,626	10,322
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	3,694,744	3,956,159	313,314	335,482
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)	16,534,991	17,453,738	1,402,080	1,479,982
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%)	194,726	155,062	16,512	13,149
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%)	421,120	419,324	33,689	33,545
11	未決済取引	156,510	156,294	13,272	13,253
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	1,548,577	1,895,836	123,886	151,666
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	1,548,577	1,895,836	123,886	151,666
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	4,021,218	3,592,396	321,697	287,391
17	うち、標準的方式適用分	4,016,439	3,586,009	321,315	286,880
18	うち、内部モデル方式適用分	4,779	6,386	382	510
19	オペレーショナル・リスク	687,106	687,106	54,968	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	687,106	687,106	54,968	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	62,785	62,716	5,324	5,318
	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	36,938,655	37,784,467	3,097,542	3,169,794

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(2021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	8,690,040	
2	当四半期中 の要因別の 変動額	資産の規模	306,722
3		ポートフォリオの質	△ 141,479
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	6,076
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	8,861,359	

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(2021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2021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(2021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	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	1,994	4,391	-	-		6,386
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	4.32	3.55	-	-		3.76
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	460	1,235	-	-		1,696
2	当四半期中の要因別の変動額	リスク量の変動	-101	-408	-	-	-509
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	10	-	-	16
7		その他	35	-	-	-	35
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	401	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	3.60	3.97	-	-		3.85
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	1,446	3,332	-	-		4,779