

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	
		2022年9月末	2022年6月末	2022年9月末	2022年6月末
1	信用リスク	9,420,539	8,823,304	797,221	746,879
2	うち、標準的手法適用分	206,158	144,203	16,492	11,536
3	うち、内部格付手法適用分	9,078,835	8,544,801	769,885	724,599
	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	135,545	134,299	10,843	10,743
4	カウンターパーティ信用リスク	590,422	563,740	48,147	46,122
5	うち、SA-CCR適用分	80,364	93,464	6,814	7,925
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	79,506	91,335	6,360	7,306
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	320,585	259,179	25,646	20,734
	その他	109,967	119,761	9,325	10,155
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	4,095,276	3,804,019	347,279	322,580
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)	18,010,746	18,258,925	1,527,239	1,548,303
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%)	176,735	164,532	14,987	13,952
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%)	887,904	608,344	71,032	48,667
11	未決済取引	158,373	173,361	13,430	14,701
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	1,890,780	1,718,310	151,262	137,464
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	1,890,780	1,718,310	151,262	137,464
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	1,780,902	1,889,728	142,472	151,178
17	うち、標準的方式適用分	1,776,640	1,887,326	142,131	150,986
18	うち、内部モデル方式適用分	4,261	2,401	340	192
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	1,329,086	381,790	112,706	32,375
	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	39,177,203	37,222,493	3,292,693	3,129,141

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	8,544,801	
2	当四半期中 の要因別の 変動額	資産の規模	588,971
3		ポートフォリオの質	△ 156,451
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	101,513
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	9,078,835	

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2022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(2022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	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	1,350	1,051	-	-		2,401
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	2.26	2.36	-	-		2.30
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	596	443	-	-		1,040
2	当四半期中の要因別の 変動額	リスク量の変動	408	927	-	-	1,336
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	△0	0	-	-	△0
7	その他	△ 354	-	-	-	-	△ 354
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	650	1,371	-	-		2,022
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	2.73	1.80	-	-		2.10
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	1,780	2,481	-	-		4,261