

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	
		2022年6月末	2022年3月末	2022年6月末	2022年3月末
1	信用リスク	8,823,304	8,503,594	746,879	719,616
2	うち、標準的手法適用分	144,203	159,087	11,536	12,727
3	うち、内部格付手法適用分	8,544,801	8,193,628	724,599	694,819
	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	134,299	150,877	10,743	12,070
4	カウンターパーティ信用リスク	563,740	701,047	46,122	57,324
5	うち、SA-CCR適用分	93,464	117,866	7,925	9,995
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	91,335	119,115	7,306	9,529
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	259,179	323,522	20,734	25,881
	その他	119,761	140,543	10,155	11,918
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	3,804,019	3,865,629	322,580	327,805
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)	18,258,925	18,033,078	1,548,303	1,529,162
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%)	164,532	158,723	13,952	13,459
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%)	608,344	500,006	48,667	40,000
11	未決済取引	173,361	163,354	14,701	13,852
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	1,718,310	1,549,274	137,464	123,941
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	1,718,310	1,549,274	137,464	123,941
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	1,889,728	2,942,611	151,178	235,408
17	うち、標準的方式適用分	1,887,326	2,937,924	150,986	235,033
18	うち、内部モデル方式適用分	2,401	4,686	192	374
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	381,790	65,970	32,375	5,594
	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	37,222,493	37,319,723	3,129,141	3,133,081

農林中央金庫

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	8,193,628
2	当四半期中 の要因別の 変動額	資産の規模
3		213,651
4		ポートフォリオの質
5		△ 108,754
6		モデルの更新
7		-
8		手法及び方針
9	買収又は売却	
10	-	
11	為替の変動	
12	246,275	
13	その他	
14	-	
15	当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	8,544,801

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2022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(2022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		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	1,795	2,890	-	-		4,686
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	17.82	27.07	-	-		22.58
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	100	106	-	-		207
2	当四半期中の要因別の変動額	リスク量の変動	584	334	-	-	918
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	2	-	-	8
7	その他	△ 171	-	-	-	-	△ 171
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	596	443	-	-		1,040
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	2.26	2.36	-	-		2.30
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	1,350	1,051	-	-		2,401