

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(2023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	
		2023年9月末	2023年6月末	2023年9月末	2023年6月末
1	信用リスク	12,749,792	12,954,838	1,019,983	1,036,387
2	うち、標準的手法適用分	5,171,681	5,248,496	413,734	419,879
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	5,018,600	5,236,337	401,488	418,906
4	うち、スロットティング・クライテリア適用分	2,136,835	2,056,166	170,946	164,493
5	うち、先進的内部格付手法適用分	275,872	264,891	22,069	21,191
	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	146,802	148,947	11,744	11,915
6	カウンターパーティ信用リスク	250,109	240,704	20,008	19,256
7	うち、SA-CCR適用分	79,854	76,848	6,388	6,147
8	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	105,598	100,293	8,447	8,023
9	その他	64,656	63,562	5,172	5,084
10	CVAリスク	94,485	95,030	7,558	7,602
	うち、SA-CVA適用分	-	-	-	-
	うち、完全なBA-CVA適用分	-	-	-	-
	うち、限定的なBA-CVA適用分	94,485	95,030	7,558	7,602
11	経過措置により適用されるマーケット・ベース方式に基づく株式等エクスポージャー	-	-	-	-
12	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)	11,267,310	12,457,189	901,384	996,575
13	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(マニフェスト方式)	-	-	-	-
	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%)	125,836	175,204	10,066	14,016
14	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%)	812,700	1,238,860	65,016	99,108
15	未決済取引	-	47,497	-	3,799
16	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	2,226,653	2,070,819	178,132	165,665
17	うち、内部格付手法準拠方式適用分	-	-	-	-
18	うち、外部格付準拠方式適用分又は内部評価方式適用分	2,226,653	2,070,819	178,132	165,665
19	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
20	マーケット・リスク	863,410	5,199,492	69,072	415,959
21	うち、標準的方式適用分	863,410	5,199,492	69,072	415,959
22	うち、内部モデル方式適用分	-	-	-	-
	うち、簡易的方式適用分	-	-	-	-
23	勘定間の振替分	-	-	-	-
24	オペレーショナル・リスク	1,046,324	1,046,324	83,705	83,705
25	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	1,248,105	1,190,092	99,848	95,207
26	フロア調整	-	-	-	-
27	合計	30,684,728	36,716,053	2,454,778	2,937,284

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(2023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	7,557,395
2	当四半期中 の要因別の 変動額	資産の規模 40,161
3		ポートフォリオの質 △ 229,749
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 63,500
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	7,431,308

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(2023年9月末・連結)

(単位:百万円)

CMS1:内部モデルを用いた手法と標準的手法のリスク・アセットの比較					
項番		イ	ロ	ハ	ニ
		リスク・アセットの額			
		内部モデルを用いて算出したリスク・アセットの額	標準的な手法適用分のリスク・アセットの額	リスク・アセットの額	資本フロア計算に用いられる、標準的な手法により算出したリスク・アセットの額(フロア掛け目前)
1	信用リスク	7,431,308	5,171,681	12,602,989	18,636,734
2	カウンターパーティ信用リスク	144,510	105,598	250,109	352,566
3	CVAリスク		94,485	94,485	94,485
4	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	-	2,226,653	2,226,653	2,226,653
5	マーケット・リスク	-	863,410	863,410	863,410
6	オペレーショナル・リスク		1,046,324	1,046,324	1,046,324
7	その他リスク・アセット		13,600,755	13,600,755	15,524,660
8	合計	7,575,818	23,108,910	30,684,728	38,744,836