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(2021年12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12月末	2021年9月末	2021年12月末	2021年9月末
1	信用リスク	8,401,125	8,360,940	KM1	707,882
2	うち、標準的手法適用分	87,500	67,648	7,000	5,411
3	うち、内部格付手法適用分	8,141,018	8,126,611	690,358	689,136
	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	172,605	166,679	13,808	13,334
4	カウンターパーティ信用リスク	493,373	500,020	40,278	40,814
5	うち、SA-CCR適用分	59,788	58,546	5,070	4,964
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	–	–	–	–
	うち、CVAリスク	66,643	65,817	5,331	5,265
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	258,332	264,754	20,666	21,180
	その他	108,610	110,901	9,210	9,404
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	3,667,396	3,498,826	310,995	296,700
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)	17,543,100	17,157,382	1,487,604	1,454,890
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(マンデート方式)	–	–	–	–
	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%)	201,082	160,555	17,051	13,615
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%)	531,297	581,461	42,503	46,516
11	未決済取引	161,435	157,683	13,689	13,371
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	1,428,466	1,419,194	114,277	113,535
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	1,428,466	1,419,194	114,277	113,535
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	4,265,431	3,967,819	341,234	317,425
17	うち、標準的方式適用分	4,258,381	3,962,793	340,670	317,023
18	うち、内部モデル方式適用分	7,049	5,026	563	402
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	65,497	64,252	5,554	5,448
	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	37,445,312	36,555,243	3,139,324	3,065,170

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(2021年12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		8,126,611
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	80,761
3		ポートフォリオの質	△ 113,823
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	47,468
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		8,141,018

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12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12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。

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(2021年12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
			バリュー・アット・リスク	ストレス・バリュー・アット・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		1,712	3,313	–	–		5,026
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		3.49	2.14	–	–		2.46
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		490	1,545	–	–		2,035
2	当四半期中の要因別の変動額	リスク量の変動	−284	−478	–	–		−762
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	1	0	–	–		1
7		その他	30	–	–	–		30
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		236	1,067	–	–		1,304
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		11.11	4.13	–	–		5.40
8c	当四半期末におけるリスク・アセット		2,633	4,416	–	–		7,049