

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(2026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	
		2026年6月末	2026年3月末	2026年6月末	2026年3月末
1	信用リスク	12,729,993	12,354,409	1,018,399	988,352
2	うち、標準的手法適用分	5,959,112	5,483,413	476,729	438,673
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	4,636,268	4,728,542	370,901	378,283
4	うち、スロットティング・クライテリア適用分	170,805	197,839	13,664	15,827
5	うち、先進的内部格付手法適用分	1,811,708	1,786,534	144,936	142,922
	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	152,098	158,079	12,167	12,646
6	カウンターパーティ信用リスク	190,789	204,427	15,263	16,354
7	うち、SA-CCR適用分	70,736	89,253	5,658	7,140
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	67,934	62,983	5,434	5,038
9	その他	52,118	52,191	4,169	4,175
10	CVAリスク	87,051	113,356	6,964	9,068
	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	87,051	113,356	6,964	9,068
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)	7,865,199	7,216,264	629,215	577,301
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(マンドート方式)	220,548	212,332	17,643	16,986
	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%)	118,377	91,778	9,470	7,342
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%)	211,811	236,428	16,944	18,914
15	未決済取引	4,742	-	379	-
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	2,962,058	3,073,229	236,964	245,858
17	うち、内部格付手法準拠方式適用分	-	-	-	-
18	うち、外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分	2,962,058	3,073,229	236,964	245,858
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	3,471,463	2,921,037	277,717	233,683
21	うち、標準的方式適用分	3,471,463	2,921,037	277,717	233,683
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	2,032,943	2,032,943	162,635	162,635
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	164,849	156,996	13,187	12,559
26	フロア調整	-	-	-	-
27	合計	30,059,828	28,613,206	2,404,786	2,289,056

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(2026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	6,712,916
2	当四半期中 の要因別の 変動額	資産の規模
3		ポートフォリオの質
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
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	6,618,782

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(2026年6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 (フロア掛目前)
1	信用リスク	6,618,782	5,959,112	12,577,895	20,074,892
2	カウンターパーティ信用リスク	122,855	67,934	190,789	335,604
3	CVAリスク		87,051	87,051	87,051
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				
		－	2,962,058	2,962,058	2,962,058
5	マーケット・リスク	－	3,471,463	3,471,463	3,471,463
6	オペレーショナル・リスク		2,032,943	2,032,943	2,032,943
7	その他リスク・アセット		8,737,626	8,737,626	10,075,904
8	合計	6,741,638	23,318,189	30,059,828	39,039,918