

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(2025年3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	
		2025年3月末	2024年12月末	2025年3月末	2024年12月末
1	信用リスク	11,257,912	11,654,877	900,633	932,390
2	うち、標準的手法適用分	4,633,581	4,579,076	370,686	366,326
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	4,515,920	4,486,129	361,273	358,890
4	うち、スロットティング・クライテリア適用分	264,771	2,182,569	21,181	174,605
5	うち、先進的内部格付手法適用分	1,685,423	248,104	134,833	19,848
	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	158,215	158,997	12,657	12,719
6	カウンターパーティ信用リスク	207,169	196,816	16,573	15,745
7	うち、SA-CCR適用分	110,657	74,082	8,852	5,926
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	46,986	49,880	3,758	3,990
9	その他	49,526	72,854	3,962	5,828
10	CVAリスク	151,282	98,637	12,102	7,891
	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	151,282	98,637	12,102	7,891
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)	5,773,291	6,787,428	461,863	542,994
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)	81,245	42,191	6,499	3,375
	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%)	108,045	155,116	8,643	12,409
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%)	221,181	773,518	17,694	61,881
15	未決済取引	22	18,126	1	1,450
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	2,457,931	2,453,308	196,634	196,264
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	2,457,931	2,453,308	196,634	196,264
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	3,487,433	2,469,664	278,994	197,573
21	うち、標準的方式適用分	3,487,433	2,469,664	278,994	197,573
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	2,203,383	1,612,711	176,270	129,016
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	146,713	115,094	11,737	9,207
26	フロア調整	-	-	-	-
27	合計	26,095,613	26,377,493	2,087,649	2,110,199

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(2025年3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		6,916,803
2	当四半期中 の要因別の 変動額	資産の規模	244,182
3		ポートフォリオの質	△ 92,266
4		モデルの更新	△ 462,966
5		手法及び方針	-
6		買収又は売却	-
7		為替の変動	△ 139,638
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		6,466,115

注: 項番4 モデルの更新の変動は、一部アセットのリスク計測手法の変更によるもの。

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(2025年3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	6,466,115	4,633,581	11,099,697	17,738,495
2	カウンターパーティ信用リスク	160,183	46,986	207,169	341,289
3	CVAリスク		151,282	151,282	151,282
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				
		－	2,457,931	2,457,931	2,457,931
5	マーケット・リスク	－	3,487,433	3,487,433	3,487,433
6	オペレーショナル・リスク		2,203,383	2,203,383	2,203,383
7	その他リスク・アセット		6,488,715	6,488,715	7,983,827
8	合計	6,626,298	19,469,314	26,095,613	34,363,643