

新告示を適用する2023年3月末基準日前に終了する四半期に係る事項の開示については、従前の計表により開示いたします。

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3月末・単体)

(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3月末	2022年12月末	2023年3月末	2022年12月末
1	信用リスク	11,791,686		943,334	
2	うち、標準的手法適用分	5,414,557		433,164	
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	4,375,314		350,025	
4	うち、スロットティング・クライテリア適用分	1,600,732		128,058	
5	うち、先進的内部格付手法適用分	256,578		20,526	
	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	144,504		11,560	
6	カウンターパーティ信用リスク	239,291		19,143	
7	うち、SA-CCR適用分	45,855		3,668	
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	59,856		4,788	
9	その他	133,579		10,686	
10	CVAリスク	62,862		5,028	
	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	62,862		5,028	
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)	11,765,748		941,259	
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%)	136,964		10,957	
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%)	851,633		68,130	
15	未決済取引	-		-	
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	1,831,289		146,503	
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	1,831,289		146,503	
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	-		-	
20	マーケット・リスク	1,573,493		125,879	
21	うち、標準的方式適用分	1,573,493		125,879	
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	991,603		79,328	
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	1,017,521		81,401	
26	フロア調整	-		-	
27	合計	30,262,094		2,420,967	

## 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3月末・単体)

(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3月末	2022年12月末	2023年3月末	2022年12月末
1	信用リスク		7,927,756		671,558
2	うち、標準的手法適用分		10,767		861
3	うち、内部格付手法適用分		7,778,828		659,644
	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		138,160		11,052
4	カウンターパーティ信用リスク		634,625		52,133
5	うち、SA-CCR適用分		124,983		10,598
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分		-		-
	うち、CVAリスク		116,688		9,335
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー		233,958		18,716
	その他		158,994		13,482
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		3,660,233		310,387
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)		16,079,713		1,363,500
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%)		172,574		14,634
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%)		910,492		72,839
11	未決済取引		-		-
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		1,840,736		147,258
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		1,840,736		147,258
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
16	マーケット・リスク		1,338,304		107,064
17	うち、標準的方式適用分		1,326,995		106,159
18	うち、内部モデル方式適用分		11,308		904
19	オペレーショナル・リスク		790,677		63,254
20	うち、基礎的手法適用分		-		-
21	うち、粗利益配分手法適用分		790,677		63,254
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		1,327,722		112,590
	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		34,682,834		2,915,221