2024年8月23日
株式会社商工組合中央金庫

（単位：百万円）

OV1：リスク・アセットの概要（単体）

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	
		当四半期末（2024年6月末）	前四半期末（2024年3月末）	当四半期末（2024年6月末）	前四半期末（2024年3月末）
1	信用リスク	8,191,209	8,143,330	655,296	651,466
2	うち、標準的手法適用分	8,142,820	8,095,433	651,425	647,634
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	－	－	－	－
4	うち、スロッティング・クライテリア適用分	－	－	－	－
5	うち、先進的内部格付手法適用分	－	－	－	－
	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	48,389	47,897	3,871	3,831
6	カウンターパーティ信用リスク	35,742	35,821	2,859	2,865
7	うち、SA－CCR適用分	34,652	34,759	2,772	2,780
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	1,049	895	83	71
9	その他	41	166	3	13
10	CVAリスク	38,403	41,463	3,072	3,317
	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	38,403	41,463	3,072	3,317
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）	53,375	51,791	4,270	4,143
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（マンデート方式）	4,445	4,446	355	355
	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％）	27,518	25,962	2,201	2,077
	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％）	－	－	－	－
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％）	－	－	－	－
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	5,164	6,123	413	489
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	2,532	2,726	202	218
19	うち、標準的手法準拠方式適用分	2,631	3,396	210	271
	うち、1250％のリスク・ウェイト適用分	－	－	－	－
20	マーケット・リスク	－	－	－	－
21	うち、標準的方式適用分	－	－	－	－
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	266,859	266,859	21,348	21,348
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	148,715	138,031	11,897	11,042
26	フロア調整	－	－	－	－
27	合計	8,771,434	8,713,829	701,714	697,106