

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が適用されるエクスポージャー

●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が適用されるエクスポージャーの額

(単位：百万円)

区分	連結		単体	
	2020年度中間期	2021年度中間期	2020年度中間期	2021年度中間期
ルック・スルー方式	138,730	173,386	138,718	173,375
マンドート方式	10,987	16,972	10,987	16,948
蓋然性方式 (250%)	-	-	-	-
蓋然性方式 (400%)	99	-	99	-
フォールバック方式 (1250%)	535	64	535	64
合計	150,352	190,424	150,340	190,389

- (注) 1. ルック・スルー方式とは、当該エクスポージャーの裏付けとなる個々の資産の信用リスク・アセットを算出し足し上げる方式であります。
 2. マンドート方式とは、ファンドの運用基準に基づき最も信用リスク・アセットが大きくなる資産構成を想定し、個々の資産の信用リスク・アセットを足し上げる方式であります。
 3. 蓋然性方式とは、当該エクスポージャーの裏付けとなる資産のリスク・ウェイトの加重平均が250% (400%) を下回る蓋然性が高い場合は250% (400%) のリスク・ウェイトを適用する方式であります。
 4. フォールバック方式とは、上記以外の場合に1250%のリスク・ウェイトを適用する方式であります。

金利リスク

●金利リスクに関する事項

IRRBB 1:金利リスク

(単位：百万円)

項番		連結			
		イ	ロ	ハ	ニ
		△EVE		△NII	
		2021年度中間期	2020年度中間期	2021年度中間期	2020年度中間期
1	上方パラレルシフト	12,655	17,275	△41	4,961
2	下方パラレルシフト	24	0	31,754	18,919
3	スティープ化	2,202	1,476		
4	フラット化				
5	短期金利上昇				
6	短期金利低下				
7	最大値	12,655	17,275	31,754	18,919
		ホ		ハ	
8	自己資本の額	2021年度中間期		2020年度中間期	
		454,078		436,218	

(単位：百万円)

項番		単体			
		イ	ロ	ハ	ニ
		△EVE		△NII	
		2021年度中間期	2020年度中間期	2021年度中間期	2020年度中間期
1	上方パラレルシフト	12,655	17,275	△41	4,961
2	下方パラレルシフト	24	0	31,754	18,919
3	スティープ化	2,202	1,476		
4	フラット化				
5	短期金利上昇				
6	短期金利低下				
7	最大値	12,655	17,275	31,754	18,919
		ホ		ハ	
8	自己資本の額	2021年度中間期		2020年度中間期	
		434,436		419,811	