

## 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	
	2021年度中間期末	2022年度中間期末	2021年度中間期末	2022年度中間期末
ルック・スルー方式	173,386	170,382	173,375	170,359
マンドート方式	16,972	20,797	16,948	20,760
蓋然性方式 (250%)	-	-	-	-
蓋然性方式 (400%)	-	-	-	-
フォールバック方式 (1250%)	64	12	64	12
合計	190,424	191,193	190,389	191,132

- (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	
		2022年度中間期末	2021年度中間期末	2022年度中間期末	2021年度中間期末
1	上方パラレルシフト	7,987	12,655	3,544	△41
2	下方パラレルシフト	4,314	24	20,183	31,754
3	スティープ化	1,632	2,202		
4	フラット化				
5	短期金利上昇				
6	短期金利低下				
7	最大値	7,987	12,655	20,183	31,754
		ホ		へ	
8	自己資本の額	2022年度中間期末		2021年度中間期末	
		474,069		454,078	

(単位：百万円)

項番		単体			
		イ	ロ	ハ	ニ
		△EVE		△NII	
		2022年度中間期末	2021年度中間期末	2022年度中間期末	2021年度中間期末
1	上方パラレルシフト	7,987	12,655	3,544	△41
2	下方パラレルシフト	4,314	24	20,183	31,754
3	スティープ化	1,632	2,202		
4	フラット化				
5	短期金利上昇				
6	短期金利低下				
7	最大値	7,987	12,655	20,183	31,754
		ホ		へ	
8	自己資本の額	2022年度中間期末		2021年度中間期末	
		452,667		434,436	