

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年度末	2022年度末	2021年度末	2022年度末
リスク・スルー方式	181,145	177,647	181,129	177,621
マンドート方式	16,737	11,609	16,717	11,603
蓋然性方式 (250%)	-	-	-	-
蓋然性方式 (400%)	-	-	-	-
フォールバック方式 (1250%)	30	177	30	177
合計	197,913	189,434	197,876	189,402

- (注) 1. リスク・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年度末	2021年度末	2022年度末	2021年度末
1	上方パラレルシフト	3,612	12,584	1,348	△1,710
2	下方パラレルシフト	9,066	2,962	23,016	34,178
3	スティープ化	1,701	4,044		
4	フラット化				
5	短期金利上昇				
6	短期金利低下				
7	最大値	9,066	12,584	23,016	34,178
		ホ		へ	
		2022年度末		2021年度末	
8	自己資本の額	479,294		460,321	

(単位：百万円)

項番		単体			
		イ	ロ	ハ	ニ
		△EVE		△NII	
		2022年度末	2021年度末	2022年度末	2021年度末
1	上方パラレルシフト	3,612	12,584	1,348	△1,710
2	下方パラレルシフト	9,066	2,962	23,016	34,178
3	スティープ化	1,701	4,044		
4	フラット化				
5	短期金利上昇				
6	短期金利低下				
7	最大値	9,066	12,584	23,016	34,178
		ホ		へ	
		2022年度末		2021年度末	
8	自己資本の額	458,036		440,035	