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	
	2019年度中間期	2020年度中間期	2019年度中間期	2020年度中間期
ルック・スルー方式	98,207	138,730	98,203	138,718
マンデート方式	8,348	10,987	8,347	10,987
蓋然性方式（250%）	979	-	979	-
蓋然性方式（400%）	1,288	99	1,288	99
フォールバック方式（1250%）	365	535	365	535
合計	**109,188**	**150,352**	**109,184**	**150,340**

（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. マンデート方式とは、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	
		2020年度中間期	2019年度中間期	2020年度中間期	2019年度中間期
1	上方パラレルシフト	17,275	9,181	4,961	
2	下方パラレルシフト	0	6,204	18,919	
3	スティープ化	1,476	1,223		
4	フラット化				
5	短期金利上昇				
6	短期金利低下				
7	最大値	17,275	9,181	18,919	
		ホ		ヘ	
		2020年度中間期		2019年度中間期	
8	自己資本の額	436,218		424,665	

（単位：百万円）

項番		単体			
		イ	ロ	ハ	ニ
		⊿EVE		⊿NII	
		2020年度中間期	2019年度中間期	2020年度中間期	2019年度中間期
1	上方パラレルシフト	17,275	9,181	4,961	
2	下方パラレルシフト	0	6,204	18,919	
3	スティープ化	1,476	1,223		
4	フラット化				
5	短期金利上昇				
6	短期金利低下				
7	最大値	17,275	9,181	18,919	
		ホ		ヘ	
		2020年度中間期		2019年度中間期	
8	自己資本の額	419,811		409,146	