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	2020年度	2019年度	2020年度
ルック・スルー方式	128,423	157,372	128,411	157,360
マンデート方式	9,306	15,997	9,306	15,973
蓋然性方式（250%）	-	-	-	-
蓋然性方式（400%）	1,045	-	1,045	-
フォールバック方式（1250%）	754	263	754	263
合計	**139,530**	**173,632**	**139,518**	**173,597**

（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	2019年度	2020年度	2019年度
1	上方パラレルシフト	14,178	16,619	△634	8,391
2	下方パラレルシフト	3	1,169	30,974	14,116
3	スティープ化	3,554	1,393		
4	フラット化				
5	短期金利上昇				
6	短期金利低下				
7	最大値	14,178	16,619	30,974	14,116
		ホ		ヘ	
		2020年度		2019年度	
8	自己資本の額	443,582		432,696	

（単位：百万円）

項番		単体			
		イ	ロ	ハ	ニ
		⊿EVE		⊿NII	
		2020年度	2019年度	2020年度	2019年度
1	上方パラレルシフト	14,178	16,619	△634	8,391
2	下方パラレルシフト	3	1,169	30,974	14,116
3	スティープ化	3,554	1,393		
4	フラット化				
5	短期金利上昇				
6	短期金利低下				
7	最大値	14,178	16,619	30,974	14,116
		ホ		ヘ	
		2020年度		2019年度	
8	自己資本の額	425,067		417,179	