

[信用リスク量分析]

有価証券 信用リスク枠	1,000,000	信用リスク枠に占める割合 (VaR稼働率)	9.0%
有価証券 全体リスク枠	6,000,000	有価証券枠に占める割合 (VaR稼働率)	1.5%

(単位: 千円)

信用リスク期待損失 EL	39,365		
信用リスク 99%VaR	90,070	信用リスク	90,070
信用リスク 最終償還リスク	293,622	信用リスク	293,622
		その他信用リスク 99%VaR	0

仕組み預金、シンジケート
ローン等その他の信用リ

上場社債の信用リスク

※その他の信用リスクには預金等の信用リスクが該当する。

社債信用分析

(単位: 千円)

社債クーポン収入	848,959		
信用リスク調整後収益	306,405	デフォルト懸念該当銘柄数	0

※リスク調整後収益とは実際の収益ではなく経営管理上の目標収益で+であることが望ましい。

(単位: 千円)

	簿価額 (百万)	銘柄数	残存期間	平均クーポン	理論クーポン	クーポン収入	理論クーポン 収入	リスク調整後 収益	期待損失	信頼区間 99%	最終償還 信用リスク
Green-1	22,040	41	2.997	0.838%	0.774%	184,635	170,683	13,952	604	976	35,350
Green-2	50,163	33	4.320	1.273%	0.725%	638,666	363,543	275,124	37,205	87,175	252,871
Yellow-1	979	1	2.221	2.622%	0.851%	25,657	8,327	17,330	1,556	1,920	5,402
Yellow-2	0	0	-	-	-	0	0	0	0	0	0
Red-1	0	0	-	-	-	0	0	0	0	0	0
Red-2	0	0	-	-	-	0	0	0	0	0	0
合計	73,181	75	-	1.160%	0.741%	848,959	542,553	306,405	39,365	90,070	293,622

※最終信用リスクとは残存期間持ちきりまでの全体のリスク量を示す。