

Ⅳ. 信用リスク削減手法

信用リスク削減手法を適用したエクスポージャー

【連結】

(単位：百万円)

区分		平成19年9月30日
適格金融資産担保	現金及び自行預金	67,194
	金	—
	債券	—
	株式	6,063
	投資信託等	—
	合計	73,257
保証 クレジット・デリバティブ	保証	470,467
	クレジット・デリバティブ	—
	合計	470,467

【単体】

(単位：百万円)

区分		平成19年9月30日
適格金融資産担保	現金及び自行預金	67,194
	金	—
	債券	—
	株式	6,063
	投資信託等	—
	合計	73,257
保証 クレジット・デリバティブ	保証	469,301
	クレジット・デリバティブ	—
	合計	469,301

(注) 当行では、自己資本比率算出における信用リスク削減手法として包括的手法を採用しております。

Ⅴ. 派生商品取引の取引相手のリスク

1. 与信相当額の算出に用いる方式

先渡、スワップ、オプションその他の派生商品取引の与信相当額はカレント・エクスポージャー方式にて算出しております。

2. グロス再構築コストの額（零を下回らないものに限る。）の合計額

(単位：百万円)

		平成19年9月30日
連結		2,761
単体		2,761

3. 与信相当額

与信相当額は、グロスの再構築コストの額及びグロスのアドオンにより算出しております。担保による信用リスク削減手法の効果を勘案する取引はありません。

【連結】

(単位：百万円)

種類及び取引の区分	平成19年9月30日		
	グロスの再構築コスト (A)	グロスのアドオン (B)	与信相当額 (A) + (B)
派生商品取引	2,761	9,886	12,647
外国為替関連取引	2,238	9,136	11,374
金利関連取引	523	749	1,273
その他の派生商品取引	—	—	—
クレジット・デリバティブ	—	—	—
合計	2,761	9,886	12,647

【単体】

(単位：百万円)

種類及び取引の区分	平成19年9月30日		
	グロスの再構築コスト (A)	グロスのアドオン (B)	与信相当額 (A) + (B)
派生商品取引	2,761	9,886	12,647
外国為替関連取引	2,238	9,136	11,374
金利関連取引	523	749	1,273
その他の派生商品取引	—	—	—
クレジット・デリバティブ	—	—	—
合計	2,761	9,886	12,647

(注) 原契約期間が14日以内の外国為替関連取引の与信相当額は上記記載から除いております。