

Ⅶ. 銀行勘定における出資等エクスポージャー

1. 出資等エクスポージャーの貸借対照表計上額等

(単位：百万円)

	連結				単体			
	平成19年度中間期末		平成20年度中間期末		平成19年度中間期末		平成20年度中間期末	
	貸借対照表計上額	時価	貸借対照表計上額	時価	貸借対照表計上額	時価	貸借対照表計上額	時価
上場している出資等エクスポージャー	282,305	282,305	185,366	185,366	282,072	282,072	185,200	185,200
上記に該当しない出資等エクスポージャー	4,531	4,531	4,107	4,107	6,066	6,066	5,611	5,611
合計	286,837	286,837	189,473	189,473	288,139	288,139	190,811	190,811

2. 出資等エクスポージャーの売却及び償却に伴う損益の額

(単位：百万円)

	連結		単体	
	平成19年度中間期末	平成20年度中間期末	平成19年度中間期末	平成20年度中間期末
売却損益額	347	△531	347	△531
償却額	218	676	216	676

3. 貸借対照表で認識され、かつ、損益計算書で認識されない評価損益の額

(単位：百万円)

	連結		単体	
	平成19年度中間期末	平成20年度中間期末	平成19年度中間期末	平成20年度中間期末
評価損益の額	131,252	45,955	131,375	45,994

4. 貸借対照表及び損益計算書で認識されない評価損益の額

該当事項はありません。

5. 自己資本比率告示第6条第1項第1号及び第18条第1項第1号の規定により補完的項目に算入した額

(単位：百万円)

	連結		単体	
	平成19年度中間期末	平成20年度中間期末	平成19年度中間期末	平成20年度中間期末
補完的項目に算入した額	59,063	20,679	59,118	20,697

(注) 上記1.から5.の額には、株式のほか、自己資本比率の算出において当該ファンド自体が出資等エクスポージャーに区分されるもの(ETF及びREIT)を含めております。その他のファンド内の出資等エクスポージャーに係る額は含めておりません。

Ⅷ. 銀行勘定における金利リスク

銀行勘定における金利リスクに関して内部管理上使用した金利ショックに対する損益又は経済価値の増減額

【連結】

連結子会社の金利リスク量は僅少であるため、連結での金利ショックに対する経済価値の増減額の算出は行っていません。

【単体】

(単位：百万円)

	平成19年度中間期末	平成20年度中間期末
金利リスク合計額	43,037	62,862
国内債券	27,052	49,132
外国債券	1,065	2,441
円貨預貸金等	14,920	11,289

《使用した金利ショック》

VaR (バリュー・アット・リスク)

(国内債券・外国債券) 保有期間40日、観測期間250日、信頼区間99.9%

(円貨預貸金等) 保有期間40日、観測期間12か月、信頼区間99.9%

《VaRとは》

過去のデータを統計的に分析し、将来の一定期間(保有期間)において一定確率(信頼区間)で起こりうる最大の損失額を計測するリスク管理手法です。VaRの算出結果は、保有期間、信頼区間、データの計測手法によって異なります。