

VI. 証券化エクスポージャー

1. オリジネーターとなっている証券化エクスポージャー

当行がオリジネーターとなっている証券化エクスポージャーはありません。

2. 投資家として保有する証券化エクスポージャー

(1) エクスポージャーの額及び主な原資産の種類別の内訳

(単位：百万円)

| | 連結 | | 単体 | |
|-----------|------------|------------|------------|------------|
| | 平成20年度中間期末 | 平成21年度中間期末 | 平成20年度中間期末 | 平成21年度中間期末 |
| 住宅ローン債権 | 3,089 | 2,153 | 3,089 | 2,153 |
| オートローン債権 | 918 | 13 | 918 | 13 |
| その他個人向け債権 | 488 | 326 | 488 | 326 |
| リース債権 | 1,913 | 252 | 1,913 | 252 |
| 事業者向け貸付債権 | 3,745 | 1,063 | 3,745 | 1,063 |
| 商業用不動産 | 3,354 | 1,875 | 3,354 | 1,875 |
| その他 | 1,617 | 1,239 | 1,617 | 1,239 |
| 合計 | 15,126 | 6,925 | 15,126 | 6,925 |

(2) リスク・ウェイト毎の残高及び所要自己資本

【連結】

(単位：百万円)

| | 平成20年度中間期末 | | 平成21年度中間期末 | |
|--------|------------|----------|------------|----------|
| | 残高 | 所要自己資本の額 | 残高 | 所要自己資本の額 |
| 20% | 13,509 | 216 | 5,686 | 90 |
| 50% | 1,617 | 64 | 1,239 | 49 |
| 100% | — | — | — | — |
| 350% | — | — | — | — |
| 自己資本控除 | — | — | — | — |
| 合計 | 15,126 | 280 | 6,925 | 140 |

【単体】

(単位：百万円)

| | 平成20年度中間期末 | | 平成21年度中間期末 | |
|--------|------------|----------|------------|----------|
| | 残高 | 所要自己資本の額 | 残高 | 所要自己資本の額 |
| 20% | 13,509 | 216 | 5,686 | 90 |
| 50% | 1,617 | 64 | 1,239 | 49 |
| 100% | — | — | — | — |
| 350% | — | — | — | — |
| 自己資本控除 | — | — | — | — |
| 合計 | 15,126 | 280 | 6,925 | 140 |

(3) 自己資本比率告示第247条の規定により自己資本から控除したエクスポージャーの額及び主な原資産の種類別の内訳

該当事項はありません。

(4) 自己資本比率告示附則第15条の適用により算出される信用リスク・アセットの額

該当事項はありません。