

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

【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 | |
|---------------------|------------|---------|------------|---------|
| | 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 | 185,366 | 185,366 | 149,519 | 149,519 |
| 上記に該当しない出資等エクスポージャー | 4,107 | 4,107 | 3,735 | 3,735 |
| 合計 | 189,473 | 189,473 | 153,255 | 153,255 |

【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 | |
|---------------------|------------|---------|------------|---------|
| | 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 | 185,200 | 185,200 | 149,355 | 149,355 |
| 上記に該当しない出資等エクスポージャー | 5,611 | 5,611 | 5,303 | 5,303 |
| 合計 | 190,811 | 190,811 | 154,658 | 154,658 |

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 |
| 売却損益額 | △531 | △72 | △531 | △72 |
| 償却額 | 676 | 331 | 676 | 331 |

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 |
| 評価損益の額 | 45,955 | 31,198 | 45,994 | 31,239 |

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 |
| 補完的項目に算入した額 | 20,679 | 14,039 | 20,697 | 14,057 |

(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。