

8. 銀行勘定における株式等エクスポージャーに関する事項

【連結】

(単位：百万円)

	平成21年度中間期末	平成22年度中間期末
貸借対照表計上額	153,255	121,382
上場株式等エクスポージャー	149,519	117,883
上記に該当しない株式等エクスポージャー	3,735	3,498
時価	153,255	121,382
売却及び償却に伴う損益の額	△404	△981
売却損益額	△72	△654
償却額 (△)	331	326
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	31,198	19,959
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	—	—
補完的項目に算入した額 (注1)	14,039	8,981
株式等エクスポージャーの額		120,800
マーケット・ベース方式の簡易手法		21,290
マーケット・ベース方式の内部モデル手法		—
PD/LGD方式		9,407
経過措置 (注2)		90,102

【単体】

(単位：百万円)

	平成21年度中間期末	平成22年度中間期末
貸借対照表計上額	154,658	122,766
上場株式等エクスポージャー	149,355	117,738
上記に該当しない株式等エクスポージャー	5,303	5,027
時価	154,658	122,766
売却及び償却に伴う損益の額	△404	△981
売却損益額	△72	△654
償却額 (△)	331	326
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	31,239	20,019
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	—	—
補完的項目に算入した額 (注1)	14,057	9,008
株式等エクスポージャーの額		122,766
マーケット・ベース方式の簡易手法		20,841
マーケット・ベース方式の内部モデル手法		—
PD/LGD方式		9,407
経過措置 (注2)		92,517

(注) 1. 自己資本比率告示第6条第1項第1号又は第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、すなわち、その他有価証券の(連結)貸借対照表計上額の合計額から帳簿価額の合計額を控除した額の45%相当額であります。

2. 自己資本比率告示附則第13条が適用される株式等エクスポージャーであります。

9. 信用リスク・アセットのみなし計算が適用されるエクスポージャーに関する事項

信用リスク・アセットのみなし計算が適用されるエクスポージャーの額

【連結】

(単位：百万円)

	平成21年度中間期末	平成22年度中間期末
ルックスルー方式 (自己資本比率告示第167条第1項)		6,804
修正単純過半数方式 (自己資本比率告示第167条第2項)		5,550
マンドート方式 (自己資本比率告示第167条第3項)		476
簡便方式 (自己資本比率告示第167条第5項)		—
合計		12,831

【単体】

(単位：百万円)

	平成21年度中間期末	平成22年度中間期末
ルックスルー方式 (自己資本比率告示第167条第1項)		6,804
修正単純過半数方式 (自己資本比率告示第167条第2項)		5,746
マンドート方式 (自己資本比率告示第167条第3項)		791
簡便方式 (自己資本比率告示第167条第5項)		—
合計		13,342