

## 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22年度中間期末	平成23年度中間期末
貸借対照表計上額	121,382	108,347
上場株式等エクスポージャー	117,883	104,864
上記に該当しない株式等エクスポージャー	3,498	3,483
時価	121,382	108,347
売却及び償却に伴う損益の額	△981	△300
売却損益額	△654	△24
償却額 (△)	326	276
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	19,959	8,987
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)	8,981	4,044
株式等エクスポージャーの額	120,800	107,739
マーケット・ベース方式の簡易手法	21,290	17,803
マーケット・ベース方式の内部モデル手法	—	—
PD/LGD方式	9,407	13,513
経過措置 (注2)	90,102	76,423

【単体】

(単位：百万円)

	平成22年度中間期末	平成23年度中間期末
貸借対照表計上額	122,766	109,705
上場株式等エクスポージャー	117,738	104,718
上記に該当しない株式等エクスポージャー	5,027	4,986
時価	122,766	109,705
売却及び償却に伴う損益の額	△981	△300
売却損益額	△654	△24
償却額 (△)	326	276
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	20,019	9,046
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)	9,008	4,070
株式等エクスポージャーの額	122,766	109,705
マーケット・ベース方式の簡易手法	20,841	17,354
マーケット・ベース方式の内部モデル手法	—	—
PD/LGD方式	9,407	13,513
経過措置 (注2)	92,517	78,838

(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22年度中間期末	平成23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	5,970
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	3,371
マンドート方式 (自己資本比率告示第167条第3項)	476	338
簡便方式 (自己資本比率告示第167条第5項)	—	—
合計	12,831	9,680

【単体】

(単位：百万円)

	平成22年度中間期末	平成23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	5,970
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	3,585
マンドート方式 (自己資本比率告示第167条第3項)	791	610
簡便方式 (自己資本比率告示第167条第5項)	—	—
合計	13,342	10,166