

## 証券化エクスポージャー

- 銀行又は連結グループがオリジネーターである場合における信用リスク・アセットの算出対象となる証券化エクスポージャー

該当ありません。

- 銀行又は連結グループが投資家である場合における信用リスク・アセットの算出対象となる証券化エクスポージャー

- 主な原資産の種類別の内訳

(単位：百万円)

原資産の種類	平成27年3月期		平成28年3月期	
	残高		残高	
		うち再証券化 エクスポージャー		うち再証券化 エクスポージャー
アパートローン債権	38	-	15	-
住宅ローン債権	4,969	-	3,663	-
商業用不動産向け債権	-	-	-	-
中小企業向けローン債権	-	-	-	-
企業向け貸付債権	-	-	-	-
リース債権	-	-	-	-
合計	5,007	-	3,679	-

(注) 1. 全てオン・バランス取引であり、オフ・バランス取引は該当ございません。  
2. グループ会社では該当ありません。

- リスク・ウェイトの区分毎の残高及び所要自己資本の額

(単位：百万円)

リスク・ウェイト	平成27年3月期				平成28年3月期			
	残高	所要自己資本		残高	所要自己資本			
		うち再証券化 エクスポージャー	うち再証券化 エクスポージャー		うち再証券化 エクスポージャー	うち再証券化 エクスポージャー		
7%	5,007	-	29	3,679	-	21	-	
20%	-	-	-	-	-	-	-	
1,250%	-	-	-	-	-	-	-	
合計	5,007	-	29	3,679	-	21	-	

(注) 1. 全てオン・バランス取引であり、オフ・バランス取引は該当ございません。  
2. グループ会社では該当ありません。  
3. 所要自己資本の額はリスク・アセットの額×8%で算出しております。  
なお、自己資本比率告示第152条で定められた1.06のスケールリングファクターを考慮しております。

- 自己資本比率告示第247条第1項の規定により1,250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャーの額及び主な原資産の種類別の内訳

該当ありません。

- 再証券化エクスポージャーに対する信用リスク削減手法の適用について

信用リスク削減手法を適用した再証券化エクスポージャーはございません。

- 銀行又は連結グループがオリジネーターである場合におけるマーケット・リスク相当額の算出対象となる証券化エクスポージャー

該当ありません。

- 銀行又は連結グループが投資家である場合におけるマーケット・リスク相当額の算出対象となる証券化エクスポージャー

該当ありません。

## マーケット・リスク

- マーケット・リスク

マーケット・リスク相当額にかかる額を算入しておりません。