

## 信用リスク削減手法

### ●信用リスク削減手法が適用されたエクスポージャーの額

(単位：百万円)

エクスポージャー区分	平成27年9月期				平成28年9月期			
	適格金融資産担保	適格資産担保	適格保証	クレジット・デリバティブ	適格金融資産担保	適格資産担保	適格保証	クレジット・デリバティブ
標準的手法適用分	9,314	-	-	-	8,793	-	-	-
内部格付手法適用分	43,809	434,272	425,714	-	60,004	454,151	455,344	-
事業法人向け	15,546	433,463	261,217	-	17,085	453,443	236,446	-
ソブリン向け	-	809	129,343	-	-	707	183,651	-
金融機関等向け	28,263	-	-	-	42,919	-	-	-
居住用不動産向け	-	-	896	-	-	-	698	-
適格リボルビング型リテール向け	-	-	2,708	-	-	-	2,372	-
その他リテール向け	-	-	31,549	-	-	-	32,175	-
合計	53,124	434,272	425,714	-	68,798	454,151	455,344	-

- (注) 1. 連結子会社において信用リスク削減手法が適用されたエクスポージャーはございません。  
 2. 適格金融資産担保とは、現預金、国債・地方債、上場株式等であります。  
 3. 適格資産担保とは、割引手形動定の商業手形や電子記録債権、法的に有効な担保権が設定されている不動産担保等であります。

## 派生商品取引及び長期決済期間取引の取引相手のリスク

### ●派生商品取引及び長期決済期間取引の取引相手のリスクに関する事項

(単位：百万円)

項目	平成27年9月期	平成28年9月期
ネットिंग効果ならびに担保による信用リスク削減手法の効果を 勘案する前の与信相当額 (A)	8,751	10,475
グロス再構築コストの合計額	4,311	6,942
グロスのアドオンの合計額	4,440	3,532
一括清算ネットिंग契約による与信相当額削減効果額 (B)	-	-
ネットING効果勘案後で担保による信用リスク削減手法の効果を 勘案する前の与信相当額 (C) = (A) - (B)	8,751	10,475
派生商品取引	8,751	10,475
外国為替関連取引及び金関連取引	4,924	6,619
金利関連取引	3,827	3,855
株式関連取引	-	-
貴金属関連取引(金取引を除く)	-	-
その他コモディティ関連取引	-	-
クレジット・デリバティブ	-	-
長期決済期間取引	-	-
担保の額	1,226	1,473
適格金融資産担保	60	148
適格資産担保	1,165	1,325
ネットING効果ならびに担保による信用リスク削減手法の効果を 勘案した後の与信相当額	8,722	10,360

- (注) 1. 全ての派生商品取引において、与信相当額はカレントエクスポージャー方式を採用して算出しております。  
 2. 連結子会社において派生商品取引はございません。  
 3. クレジット・デリバティブに該当する取引はございません。