

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28年9月期				平成29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	8,793	-	-	-	8,101	-	-	-
内部格付手法適用分	60,004	454,151	455,344	-	71,506	479,104	403,239	-
事業法人向け	17,085	453,443	236,446	-	24,957	478,498	215,848	-
ソブリン向け	-	707	183,651	-	-	605	152,145	-
金融機関等向け	42,919	-	-	-	46,549	-	-	-
居住用不動産向け	-	-	698	-	-	-	395	-
適格リボルビング型リテール向け	-	-	2,372	-	-	-	2,282	-
その他リテール向け	-	-	32,175	-	-	-	32,566	-
合計	68,798	454,151	455,344	-	79,607	479,104	403,239	-

- (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、割引手形勘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28年9月期	平成29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)	10,475	7,155
グロス再構築コストの合計額	6,942	3,174
グロスのアドオンの合計額	3,532	3,980
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)	10,475	7,155
派生商品取引	10,475	7,155
外国為替関連取引及び金関連取引	6,619	4,615
金利関連取引	3,855	2,539
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	1,473	881
適格金融資産担保	148	51
適格資産担保	1,325	829
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	10,360	7,116

- (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。