

信用リスクに関する事項

(単位：百万円)

●信用リスクに関するエクスポージャー及び三月以上延滞エクスポージャーの期末残高

連 結

| | 平成29年9月期 | | | | | 平成30年9月期 | | | | |
|----------------|------------------------|---------|--------------|-----|---------------------------------|------------------------|---------|--------------|-------|---------------------------------|
| | 信用リスクに関するエクスポージャーの期末残高 | | | | 三月以上延滞 エクスポージャー (注2)の期末残高 | 信用リスクに関するエクスポージャーの期末残高 | | | | 三月以上延滞 エクスポージャー (注2)の期末残高 |
| | 貸出金等 (注1) | 債 券 | デリバティブ 取引 | | | 貸出金等 (注1) | 債 券 | デリバティブ 取引 | | |
| 国 内 計 | 1,158,122 | 682,383 | 215,725 | 646 | 7,827 | 1,126,688 | 690,835 | 207,050 | 1,318 | 4,405 |
| 国 外 計 | 40,496 | 1,396 | 38,607 | 280 | - | 45,887 | 1,358 | 43,989 | 286 | - |
| 地 域 別 合 計 | 1,198,619 | 683,780 | 254,332 | 926 | 7,827 | 1,172,575 | 692,193 | 251,040 | 1,605 | 4,405 |
| 製 造 業 | 85,670 | 62,645 | 16,457 | - | 2,745 | 78,540 | 61,112 | 10,598 | 0 | 227 |
| 農 業、林 業 | 4,362 | 4,268 | 50 | - | 45 | 4,611 | 4,517 | 50 | - | 43 |
| 漁 業 | 3,721 | 3,691 | 30 | - | 102 | 4,460 | 4,430 | 30 | - | 101 |
| 鉱業、採石業、砂利採取業 | 216 | 216 | - | - | - | 253 | 253 | - | - | - |
| 建 設 業 | 38,272 | 34,874 | 3,144 | - | 440 | 38,506 | 35,353 | 2,824 | - | 668 |
| 電気・ガス・熱供給・水道業 | 41,587 | 31,340 | 9,572 | - | - | 42,263 | 33,312 | 8,490 | - | - |
| 情 報 通 信 業 | 10,535 | 6,517 | 3,130 | - | 34 | 11,987 | 7,416 | 3,664 | - | 22 |
| 運輸業、郵便業 | 19,954 | 13,867 | 5,489 | - | 357 | 17,909 | 12,610 | 4,673 | - | 6 |
| 卸売業、小売業 | 100,947 | 90,692 | 8,030 | 2 | 1,401 | 99,226 | 89,857 | 7,337 | 1 | 660 |
| 金融業、保険業 | 158,205 | 47,249 | 88,788 | 596 | 375 | 171,085 | 43,306 | 113,913 | 567 | 387 |
| 不動産業、物品賃貸業 | 113,519 | 99,123 | 14,128 | - | 1,263 | 116,608 | 105,529 | 10,838 | - | 1,175 |
| 各種サービス業 | 118,019 | 111,629 | 2,945 | - | 525 | 116,120 | 111,777 | 3,613 | - | 492 |
| 国・地方公共団体 | 322,063 | 83,147 | 102,564 | - | - | 278,890 | 85,414 | 85,005 | - | - |
| 個 人 | 94,349 | 94,349 | - | - | 157 | 96,638 | 96,637 | - | - | 103 |
| そ の 他 | 87,193 | 168 | - | 326 | 378 | 95,472 | 664 | - | 1,035 | 516 |
| 業 種 別 計 | 1,198,619 | 683,780 | 254,332 | 926 | 7,827 | 1,172,575 | 692,193 | 251,040 | 1,605 | 4,405 |
| 1 年 以 下 | 339,531 | 136,397 | 39,286 | 260 | - | 311,435 | 147,316 | 43,410 | 274 | - |
| 1 年 超 3 年 以 下 | 164,947 | 85,422 | 79,444 | 81 | - | 143,182 | 81,019 | 61,751 | 411 | - |
| 3 年 超 5 年 以 下 | 126,341 | 84,834 | 41,424 | 82 | - | 114,522 | 80,747 | 33,754 | 20 | - |
| 5 年 超 7 年 以 下 | 76,195 | 59,922 | 16,070 | 203 | - | 79,695 | 59,921 | 19,190 | 584 | - |
| 7 年 超 10 年 以 下 | 110,369 | 87,143 | 23,213 | 13 | - | 114,396 | 92,230 | 22,120 | 45 | - |
| 10 年 超 | 278,885 | 223,884 | 54,893 | 107 | - | 296,784 | 225,868 | 70,813 | 102 | - |
| 期間の定めのないもの | 102,347 | 6,175 | - | 178 | - | 112,558 | 5,089 | - | 167 | - |
| 残 存 期 間 別 合 計 | 1,198,619 | 683,780 | 254,332 | 926 | - | 1,172,575 | 692,193 | 251,040 | 1,605 | - |

(注) 1. 貸出金、貸出金に係る未収金・仮払金並びにコミットメント・その他のデリバティブ以外のオフ・バランス取引であります。
2. 「三月以上延滞エクスポージャー」とは、元本又は利息の支払いが約定支払日の翌日から3カ月以上延滞しているエクスポージャー、又は引当金勘案前でリスク・ウェイトが150%以上であるエクスポージャーであります。

単 体

| | 平成29年9月期 | | | | | 平成30年9月期 | | | | |
|----------------|------------------------|---------|--------------|-----|---------------------------------|------------------------|---------|--------------|-------|---------------------------------|
| | 信用リスクに関するエクスポージャーの期末残高 | | | | 三月以上延滞 エクスポージャー (注2)の期末残高 | 信用リスクに関するエクスポージャーの期末残高 | | | | 三月以上延滞 エクスポージャー (注2)の期末残高 |
| | 貸出金等 (注1) | 債 券 | デリバティブ 取引 | | | 貸出金等 (注1) | 債 券 | デリバティブ 取引 | | |
| 国 内 計 | 1,147,831 | 684,984 | 215,725 | 646 | 7,449 | 1,115,190 | 693,129 | 207,050 | 1,318 | 3,889 |
| 国 外 計 | 40,496 | 1,396 | 38,607 | 280 | - | 45,887 | 1,358 | 43,989 | 286 | - |
| 地 域 別 合 計 | 1,188,327 | 686,381 | 254,332 | 926 | 7,449 | 1,161,077 | 694,488 | 251,040 | 1,605 | 3,889 |
| 製 造 業 | 85,355 | 62,645 | 16,457 | - | 2,745 | 78,135 | 61,112 | 10,598 | 0 | 227 |
| 農 業、林 業 | 4,362 | 4,268 | 50 | - | 45 | 4,611 | 4,517 | 50 | - | 43 |
| 漁 業 | 3,721 | 3,691 | 30 | - | 102 | 4,460 | 4,430 | 30 | - | 101 |
| 鉱業、採石業、砂利採取業 | 216 | 216 | - | - | - | 253 | 253 | - | - | - |
| 建 設 業 | 38,272 | 34,874 | 3,144 | - | 440 | 38,506 | 35,353 | 2,824 | - | 668 |
| 電気・ガス・熱供給・水道業 | 41,536 | 31,340 | 9,572 | - | - | 42,213 | 33,312 | 8,490 | - | - |
| 情 報 通 信 業 | 10,535 | 6,517 | 3,130 | - | 34 | 11,957 | 7,416 | 3,664 | - | 22 |
| 運輸業、郵便業 | 19,954 | 13,867 | 5,489 | - | 357 | 17,909 | 12,610 | 4,673 | - | 6 |
| 卸売業、小売業 | 100,947 | 90,692 | 8,030 | 2 | 1,401 | 99,186 | 89,857 | 7,337 | 1 | 660 |
| 金融業、保険業 | 158,196 | 47,249 | 88,788 | 596 | 375 | 171,076 | 43,306 | 113,913 | 567 | 387 |
| 不動産業、物品賃貸業 | 116,413 | 101,724 | 14,128 | - | 1,263 | 119,195 | 107,824 | 10,838 | - | 1,175 |
| 各種サービス業 | 118,042 | 111,629 | 2,945 | - | 525 | 116,609 | 111,777 | 3,613 | - | 492 |
| 国・地方公共団体 | 322,063 | 83,147 | 102,564 | - | - | 278,890 | 85,414 | 85,005 | - | - |
| 個 人 | 94,349 | 94,349 | - | - | 157 | 96,638 | 96,637 | - | - | 103 |
| そ の 他 | 74,360 | 168 | - | 326 | - | 81,434 | 664 | - | 1,035 | - |
| 業 種 別 計 | 1,188,327 | 686,381 | 254,332 | 926 | 7,449 | 1,161,077 | 694,488 | 251,040 | 1,605 | 3,889 |
| 1 年 以 下 | 339,651 | 136,517 | 39,286 | 260 | - | 311,665 | 147,546 | 43,410 | 274 | - |
| 1 年 超 3 年 以 下 | 165,769 | 86,243 | 79,444 | 81 | - | 143,970 | 81,808 | 61,751 | 411 | - |
| 3 年 超 5 年 以 下 | 127,501 | 85,994 | 41,424 | 82 | - | 115,798 | 82,023 | 33,754 | 20 | - |
| 5 年 超 7 年 以 下 | 76,695 | 60,422 | 16,070 | 203 | - | 79,695 | 59,921 | 19,190 | 584 | - |
| 7 年 超 10 年 以 下 | 110,369 | 87,143 | 23,213 | 13 | - | 114,396 | 92,230 | 22,120 | 45 | - |
| 10 年 超 | 278,885 | 223,884 | 54,893 | 107 | - | 296,784 | 225,868 | 70,813 | 102 | - |
| 期間の定めのないもの | 89,454 | 6,175 | - | 178 | - | 98,767 | 5,089 | - | 167 | - |
| 残 存 期 間 別 合 計 | 1,188,327 | 686,381 | 254,332 | 926 | - | 1,161,077 | 694,488 | 251,040 | 1,605 | - |

(注) 1. 貸出金、貸出金に係る未収金・仮払金並びにコミットメント・その他のデリバティブ以外のオフ・バランス取引であります。
2. 「三月以上延滞エクスポージャー」とは、元本又は利息の支払いが約定支払日の翌日から3カ月以上延滞しているエクスポージャー、又は引当金勘案前でリスク・ウェイトが150%以上であるエクスポージャーであります。

●一般貸倒引当金、個別貸倒引当金、特定海外債権引当勘定の中間期末残高及び中間期中増減額

連 結

| | 平成29年9月期 | | | 平成30年9月期 | | |
|------------|----------|---------|--------|----------|---------|--------|
| | 期首残高 | 当中間期増減額 | 中間期末残高 | 期首残高 | 当中間期増減額 | 中間期末残高 |
| 一般貸倒引当金 | 1,518 | △ 205 | 1,312 | 1,335 | 110 | 1,445 |
| 個別貸倒引当金 | 10,475 | △ 425 | 10,049 | 10,024 | 425 | 10,450 |
| 特定海外債権引当勘定 | - | - | - | - | - | - |
| 合 計 | 11,993 | △ 631 | 11,362 | 11,360 | 536 | 11,896 |

単 体

| | 平成29年9月期 | | | 平成30年9月期 | | |
|------------|----------|---------|--------|----------|---------|--------|
| | 期首残高 | 当中間期増減額 | 中間期末残高 | 期首残高 | 当中間期増減額 | 中間期末残高 |
| 一般貸倒引当金 | 1,481 | △ 202 | 1,279 | 1,293 | 85 | 1,378 |
| 個別貸倒引当金 | 10,331 | △ 405 | 9,925 | 9,892 | 326 | 10,219 |
| 特定海外債権引当勘定 | - | - | - | - | - | - |
| 合 計 | 11,812 | △ 608 | 11,204 | 11,186 | 411 | 11,598 |

●個別貸倒引当金の地域別、業種別内訳

連 結

| | 平成29年9月期 | | | 平成30年9月期 | | |
|-----------------------|----------|---------|--------|----------|---------|--------|
| | 期首残高 | 当中間期増減額 | 中間期末残高 | 期首残高 | 当中間期増減額 | 中間期末残高 |
| 国 内 計 | 10,475 | △ 425 | 10,049 | 10,024 | 425 | 10,450 |
| 国 外 計 | - | - | - | - | - | - |
| 地 域 別 合 計 | 10,475 | △ 425 | 10,049 | 10,024 | 425 | 10,450 |
| 製 造 業 | 348 | 6 | 355 | 347 | 38 | 385 |
| 農 業、林 業 | 10 | 0 | 11 | 10 | 0 | 11 |
| 漁 業 | 16 | △ 1 | 15 | 24 | △ 4 | 20 |
| 鉱業、採石業、砂利採取業 | - | - | - | - | - | - |
| 建 設 業 | 306 | 33 | 339 | 288 | 565 | 853 |
| 電気・ガス・熱供給・水道業 | - | - | - | - | - | - |
| 情 報 通 信 業 | - | - | - | 21 | △ 1 | 19 |
| 運 輸 業、郵 便 業 | 660 | 35 | 695 | 710 | 26 | 736 |
| 卸 売 業、小 売 業 | 1,408 | △ 238 | 1,170 | 1,087 | △ 174 | 913 |
| 金 融 業、保 険 業 | - | - | - | - | - | - |
| 不 動 産 業、物 品 賃 貸 業 | 727 | △ 26 | 700 | 697 | △ 33 | 663 |
| 各 種 サ ー ビ ス 業 | 6,735 | △ 192 | 6,542 | 6,614 | △ 78 | 6,535 |
| 国・地方公共団体 | - | - | - | - | - | - |
| 個 人 | 117 | △ 22 | 94 | 91 | △ 11 | 80 |
| そ の 他 (連 結 子 会 社 勘 定) | 144 | △ 20 | 124 | 132 | 99 | 231 |
| 業 種 別 合 計 | 10,475 | △ 425 | 10,049 | 10,024 | 425 | 10,450 |

(注) 1. 一般貸倒引当金及び特定海外債権引当勘定につきましては、上記区分ごとの算定を行っておりません。
2. 連結子会社は業種別の算定を行っておりませんので、その他(連結子会社勘定)に計上しております。

単 体

| | 平成29年9月期 | | | 平成30年9月期 | | |
|-------------------|----------|---------|--------|----------|---------|--------|
| | 期首残高 | 当中間期増減額 | 中間期末残高 | 期首残高 | 当中間期増減額 | 中間期末残高 |
| 国 内 計 | 10,331 | △ 405 | 9,925 | 9,892 | 326 | 10,219 |
| 国 外 計 | - | - | - | - | - | - |
| 地 域 別 合 計 | 10,331 | △ 405 | 9,925 | 9,892 | 326 | 10,219 |
| 製 造 業 | 348 | 6 | 355 | 347 | 38 | 385 |
| 農 業、林 業 | 10 | 0 | 11 | 10 | 0 | 11 |
| 漁 業 | 16 | △ 1 | 15 | 24 | △ 4 | 20 |
| 鉱業、採石業、砂利採取業 | - | - | - | - | - | - |
| 建 設 業 | 306 | 33 | 339 | 288 | 565 | 853 |
| 電気・ガス・熱供給・水道業 | - | - | - | - | - | - |
| 情 報 通 信 業 | - | - | - | 21 | △ 1 | 19 |
| 運 輸 業、郵 便 業 | 660 | 35 | 695 | 710 | 26 | 736 |
| 卸 売 業、小 売 業 | 1,408 | △ 238 | 1,170 | 1,087 | △ 174 | 913 |
| 金 融 業、保 険 業 | - | - | - | - | - | - |
| 不 動 産 業、物 品 賃 貸 業 | 727 | △ 26 | 700 | 697 | △ 33 | 663 |
| 各 種 サ ー ビ ス 業 | 6,735 | △ 192 | 6,542 | 6,614 | △ 78 | 6,535 |
| 国・地方公共団体 | - | - | - | - | - | - |
| 個 人 | 117 | △ 22 | 94 | 91 | △ 11 | 80 |
| そ の 他 | - | - | - | - | - | - |
| 業 種 別 合 計 | 10,331 | △ 405 | 9,925 | 9,892 | 326 | 10,219 |

(注) 一般貸倒引当金及び特定海外債権引当勘定につきましては、上記区分ごとの算定を行っておりません。

●業種別の貸出金償却の額

| | 貸出金償却 | | | |
|-------------------|----------|----------|----------|----------|
| | 連 結 | | 単 体 | |
| | 平成29年9月期 | 平成30年9月期 | 平成29年9月期 | 平成30年9月期 |
| 製 造 業 | 0 | 90 | 0 | 90 |
| 農 業、林 業 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 漁 業 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 鉱業、採石業、砂利採取業 | - | - | - | - |
| 建 設 業 | 6 | 5 | 6 | 5 |
| 電気・ガス・熱供給・水道業 | - | - | - | - |
| 情 報 通 信 業 | - | - | - | - |
| 運 輸 業、郵 便 業 | - | - | - | - |
| 卸 売 業、小 売 業 | 10 | 0 | 10 | 0 |
| 金 融 業、保 険 業 | - | - | - | - |
| 不 動 産 業、物 品 賃 貸 業 | 2 | 0 | 2 | 0 |
| 各 種 サ ー ビ ス 業 | 3 | 3 | 3 | 3 |
| 国・地方公共団体 | - | - | - | - |
| 個 人 | 2 | 0 | 2 | 0 |
| そ の 他 | - | - | - | - |
| その他（連結子会社勘定） | - | 0 | - | - |
| 業 種 別 計 | 25 | 101 | 25 | 100 |

(注) 連結子会社は業種別の算定を行っておりませんので、その他（連結子会社勘定）に計上しております。

●標準的手法が適用されるエクスポージャーについて、リスク・ウェイトの区分ごとの信用リスク削減手法の効果を勘案した後の残高並びに自己資本比率告示第79条の5第2項第2号、第177条の2第2項第2号及び第247条第1項（自己資本比率告示第125条、第127条及び第136条第1項において準用する場合に限る。）の規定により1250パーセントのリスク・ウェイトが適用されるエクスポージャーの額

連 結

| | 信用リスク削減手法勘案後のエクスポージャーの額 | | | |
|-------|-------------------------|---------|----------|---------|
| | 平成29年9月期 | | 平成30年9月期 | |
| | 格付適用 | 格付不適用 | 格付適用 | 格付不適用 |
| 0% | 3,409 | 353,635 | 3,425 | 302,428 |
| 10% | 5,000 | 74,175 | 3,500 | 96,806 |
| 20% | 75,086 | 8,258 | 69,523 | 10,114 |
| 35% | - | 30,733 | - | 30,672 |
| 50% | 54,276 | 6,173 | 43,849 | 6,492 |
| 75% | - | 132,693 | - | 139,111 |
| 100% | 32,536 | 375,388 | 32,302 | 391,664 |
| 150% | - | 4,361 | - | 1,470 |
| 250% | - | 8,591 | - | 13,027 |
| 350% | - | - | - | - |
| 1250% | - | - | - | - |
| 合 計 | 170,308 | 994,010 | 152,601 | 991,787 |

(注) 1. 「格付適用」とは、リスク・ウェイトの算定にあたり、格付を適用しているエクスポージャーであり、「格付不適用」とは、格付を適用していないエクスポージャーであります。なお、格付は適格格付機関が付与しているものに限られております。
2. 「格付適用」エクスポージャーには、原債務者の格付を適用しているエクスポージャーに加え、保証人の格付を適用しているエクスポージャーや、ソブリン格付に準拠したリスク・ウェイトを適用しているエクスポージャーが含まれております。
3. 格付を適用した投資信託、特定金銭信託は各ファンド毎にリスク・ウェイトを算出し、リスク・ウェイト区分の分類は、算出したリスク・ウェイト以上の最も近い区分に算入しております。

単 体

| | 信用リスク削減手法勘案後のエクスポージャーの額 | | | |
|-------|-------------------------|---------|----------|---------|
| | 平成29年9月期 | | 平成30年9月期 | |
| | 格付適用 | 格付不適用 | 格付適用 | 格付不適用 |
| 0% | 3,409 | 353,632 | 3,425 | 302,426 |
| 10% | 5,000 | 74,175 | 3,500 | 96,806 |
| 20% | 75,086 | 8,258 | 69,523 | 10,114 |
| 35% | - | 30,733 | - | 30,672 |
| 50% | 54,276 | 6,173 | 43,849 | 6,492 |
| 75% | - | 132,693 | - | 139,081 |
| 100% | 32,536 | 365,509 | 32,302 | 380,697 |
| 150% | - | 4,107 | - | 1,185 |
| 250% | - | 8,549 | - | 13,014 |
| 350% | - | - | - | - |
| 1250% | - | - | - | - |
| 合 計 | 170,308 | 983,833 | 152,601 | 980,491 |

(注) 1. 「格付適用」とは、リスク・ウェイトの算定にあたり、格付を適用しているエクスポージャーであり、「格付不適用」とは、格付を適用していないエクスポージャーであります。なお、格付は適格格付機関が付与しているものに限られております。
2. 「格付適用」エクスポージャーには、原債務者の格付を適用しているエクスポージャーに加え、保証人の格付を適用しているエクスポージャーや、ソブリン格付に準拠したリスク・ウェイトを適用しているエクスポージャーが含まれております。
3. 格付を適用した投資信託、特定金銭信託は各ファンド毎にリスク・ウェイトを算出し、リスク・ウェイト区分の分類は、算出したリスク・ウェイト以上の最も近い区分に算入しております。

信用リスク削減手法に関する事項

(単位：百万円)

●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

| | 連 結 | | 単 体 | |
|--------------------------------|----------|----------|----------|----------|
| | 平成29年9月期 | 平成30年9月期 | 平成29年9月期 | 平成30年9月期 |
| 適格金融資産担保が適用されたエクスポージャー | 5,562 | 4,645 | 5,562 | 4,645 |
| 保証又はクレジット・デリバティブが適用されたエクスポージャー | 11,593 | 9,837 | 11,593 | 9,837 |

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)

●派生商品取引の与信相当額算出に用いる方式

先渡取引、スワップ、オプションその他の派生商品取引の与信相当額はカレント・エクスポージャー方式（注）にて算出しております。

(注) カレント・エクスポージャー方式とは、デリバティブ取引の信用リスク計測手段の1つで、取引を時価評価することによって再構築コストを算出し、これに契約期間中に生じるであろう同コストの増加見込み額（ポテンシャル・エクスポージャー）を付加して算出する方法であります。

●派生商品取引のグロス再構築コストの額及び与信相当額

| | 連 結 | | 単 体 | |
|--------------------------|----------|----------|----------|----------|
| | 平成29年9月期 | 平成30年9月期 | 平成29年9月期 | 平成30年9月期 |
| グロス再構築コストの額 | 71 | 443 | 71 | 443 |
| 与信相当額（担保による信用リスク削減効果勘案前） | 926 | 1,605 | 926 | 1,605 |
| 派 生 商 品 取 引 | 926 | 1,605 | 926 | 1,605 |
| 外 国 為 替 関 連 取 引 | 720 | 902 | 720 | 902 |
| 金 利 関 連 取 引 | 171 | 281 | 171 | 281 |
| 株 式 関 連 取 引 | 34 | 272 | 34 | 272 |
| そ の 他 取 引 | — | 148 | — | 148 |
| ク レ ジ ッ ト ・ デ リ バ テ ィ ブ | — | — | — | — |
| 与信相当額（担保による信用リスク削減効果勘案後） | 926 | 1,605 | 926 | 1,605 |

(注) 1. 原契約期間が5営業日以内の外為関連取引の与信相当額は除きます。
2. 与信相当額（担保による信用リスク削減効果勘案前）は、再構築コスト及びグロスのアドオン額（想定元本額に金融庁告示第19号第79条の2に定める掛け目を乗じた額）の合計であります。

●グロス再構築コストの額の合計額及びグロスのアドオンの合計額から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を差し引いた額

平成29年9月期及び平成30年9月期ともに該当ありません。

●信用リスク削減手法に用いた担保の種類及び額

平成29年9月期及び平成30年9月期ともに該当ありません。

●与信相当額算出の対象となるクレジット・デリバティブの想定元本額

平成29年9月期及び平成30年9月期ともに該当ありません。

●信用リスク削減手法の効果を勘案するために用いるクレジット・デリバティブの想定元本額

平成29年9月期及び平成30年9月期ともに該当ありません。

証券化エクスポージャーに関する事項

(単位：百万円)

複数の資産を裏付とする資産のうち、個々の資産の把握が困難な資産に含まれる証券化エクスポージャーについては、記載しておりません。

●オリジネーターである証券化エクスポージャーに関する事項

平成29年9月期及び平成30年9月期ともに該当ありません。

●投資家である証券化エクスポージャーに関する事項

(1) 保有する証券化エクスポージャーの額及び原資産の種類別の内訳

| 主な原資産の種類 | 連 結 | | | | 単 体 | | | |
|------------|------------|--------|------------|--------|------------|--------|------------|--------|
| | 平成29年9月期 | | 平成30年9月期 | | 平成29年9月期 | | 平成30年9月期 | |
| | エクスポージャーの額 | うち再証券化 | エクスポージャーの額 | うち再証券化 | エクスポージャーの額 | うち再証券化 | エクスポージャーの額 | うち再証券化 |
| 事業用不動産向け債権 | 1,001 | - | - | - | 1,001 | - | - | - |
| 合 計 | 1,001 | - | - | - | 1,001 | - | - | - |

(2) 保有する証券化エクスポージャーのリスク・ウェイト区分ごとの残高及び所要自己資本額

連 結

| 区 分 | 平成29年9月期 | | | | 平成30年9月期 | | | |
|-------|------------|--------|------------|--------|------------|--------|------------|--------|
| | エクスポージャーの額 | うち再証券化 | 所要自己資本額(注) | うち再証券化 | エクスポージャーの額 | うち再証券化 | 所要自己資本額(注) | うち再証券化 |
| 20% | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 50% | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 100% | 1,001 | - | 40 | - | - | - | - | - |
| 350% | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 1250% | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 合 計 | 1,001 | - | 40 | - | - | - | - | - |

(注) 所要自己資本額=リスク・アセット×4%

単 体

| 区 分 | 平成29年9月期 | | | | 平成30年9月期 | | | |
|-------|------------|--------|------------|--------|------------|--------|------------|--------|
| | エクスポージャーの額 | うち再証券化 | 所要自己資本額(注) | うち再証券化 | エクスポージャーの額 | うち再証券化 | 所要自己資本額(注) | うち再証券化 |
| 20% | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 50% | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 100% | 1,001 | - | 40 | - | - | - | - | - |
| 350% | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 1250% | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 合 計 | 1,001 | - | 40 | - | - | - | - | - |

(注) 所要自己資本額=リスク・アセット×4%

(3) 自己資本比率告示第247条第1項の規定により1250%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

平成29年9月期及び平成30年9月期ともに該当ありません。

(4) 保有する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の有無及び保証人ごと又は当該保証人に適用されるリスク・ウェイトの区分ごとの内訳

平成29年9月期及び平成30年9月期ともに該当ありません。

出資等又は株式等エクスポージャーに関する事項

(単位：百万円)

複数の資産を裏付とする資産のうち、個々の資産の把握が困難な資産に含まれる出資等又は株式等エクスポージャーについては、記載しておりません。

●出資等の中間貸借対照表計上額及び時価

連 結

| | 平成29年9月期 | | 平成30年9月期 | |
|-------------|--------------|--------|--------------|--------|
| | 中間連結貸借対照表計上額 | 時価 | 中間連結貸借対照表計上額 | 時価 |
| 上場している出資等 | 17,469 | | 18,137 | |
| 上記に該当しない出資等 | 1,386 | | 1,234 | |
| 合 計 | 18,855 | 18,855 | 19,371 | 19,371 |

単 体

| | 平成29年9月期 | | 平成30年9月期 | |
|-------------|------------|--------|------------|--------|
| | 中間貸借対照表計上額 | 時価 | 中間貸借対照表計上額 | 時価 |
| 上場している出資等 | 16,870 | | 17,474 | |
| 上記に該当しない出資等 | 1,638 | | 1,958 | |
| 合 計 | 18,508 | 18,508 | 19,432 | 19,432 |

●出資等の売却及び償却に伴う損益の額

| | 連 結 | | 単 体 | |
|-------|----------|----------|----------|----------|
| | 平成29年9月期 | 平成30年9月期 | 平成29年9月期 | 平成30年9月期 |
| 売却損益額 | 130 | 495 | 130 | 495 |
| 償却額 | 5 | 1 | 5 | 8 |

●中間貸借対照表で認識され、中間損益計算書で認識されない評価損益の額、中間貸借対照表及び中間損益計算書で認識されない評価損益の額

| | 連 結 | | 単 体 | |
|-----------------------------------|----------|----------|----------|----------|
| | 平成29年9月期 | 平成30年9月期 | 平成29年9月期 | 平成30年9月期 |
| 中間貸借対照表で認識され、中間損益計算書で認識されない評価損益の額 | 5,504 | 6,213 | 5,223 | 5,868 |
| 中間貸借対照表及び中間損益計算書で認識されない評価損益の額 | - | - | - | - |

金利リスクに関して内部管理上使用した金利ショックに対する損益又は経済的価値の増減額

(単位：百万円)

●金利ショックに対する経済的価値の変動額（99%タイル値）

| 連 結 | | 単 体 | |
|----------|----------|----------|----------|
| 平成29年9月期 | 平成30年9月期 | 平成29年9月期 | 平成30年9月期 |
| 4,780 | 3,810 | 4,780 | 3,810 |

(注) 連結子会社はリスク量の算定を行っておりません。

●計測方法及び前提条件

保有期間1年、観測期間5年で計測した金利変動の1%タイル値と99%タイル値による金利ショックを与え、GPS方式により各年限毎に金利リスク量を算出しております。

なお、当行では、内部モデルによりコア預金を算定しております。普通預金など満期のない流動性預金については、過去の種類別・残高階層別の推移を基に、将来の残高動向を保守的に推計しております。