

有価証券の時価等情報

(単位：百万円)

貸借対照表の「有価証券」のほか、「商品有価証券」、「預け金」中の譲渡性預け金を含めて記載しております。

●売買目的有価証券

	平成28年9月末		平成29年9月末	
	中間貸借対照表計上額	当中間期の損益に含まれた評価差額	中間貸借対照表計上額	当中間期の損益に含まれた評価差額
売買目的有価証券	208	8	-	-

●満期保有目的の債券

平成28年9月末及び平成29年9月末ともに該当ありません。

●その他有価証券

	種類	平成28年9月末			平成29年9月末		
		中間貸借対照表計上額	取得原価	差額	中間貸借対照表計上額	取得原価	差額
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	株式	6,874	4,356	2,518	14,133	8,662	5,470
	債券	208,912	202,327	6,584	183,285	178,790	4,494
	国債	95,787	91,857	3,929	85,427	82,661	2,766
	地方債	12,619	12,051	568	9,747	9,342	404
	短期社債	-	-	-	-	-	-
	社債	100,505	98,418	2,086	88,110	86,786	1,323
	その他	48,736	46,713	2,023	54,282	52,100	2,182
	外国債券	34,008	32,736	1,271	37,896	37,021	874
小計	264,523	253,397	11,126	251,701	239,553	12,147	
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	株式	5,071	6,111	△ 1,039	2,737	2,984	△ 247
	債券	9,364	9,501	△ 136	29,110	29,342	△ 231
	国債	971	994	△ 22	944	994	△ 50
	地方債	-	-	-	1,687	1,698	△ 10
	短期社債	-	-	-	-	-	-
	社債	8,393	8,507	△ 113	26,478	26,648	△ 170
	その他	34,425	35,446	△ 1,020	33,010	33,984	△ 974
	外国債券	13,860	14,121	△ 260	8,539	8,639	△ 100
小計	48,862	51,058	△ 2,196	64,858	66,311	△ 1,452	
合計	313,385	304,456	8,929	316,559	305,865	10,694	

(注) 中間貸借対照表計上額は、各中間期末日における市場価格等に基づく時価により計上したものであります。

●時価を把握することが極めて困難と認められる有価証券の主な内容及び中間貸借対照表計上額

	平成28年9月末	平成29年9月末
	中間貸借対照表計上額	中間貸借対照表計上額
子会社・子法人等株式及び関連法人等株式		
非上場株式	318	318
組合出資金	290	280
その他有価証券		
非上場株式	896	944
組合出資金	47	94

金銭の信託の時価等情報

(単位：百万円)

●売買目的有価証券

	平成28年9月末		平成29年9月末	
	中間貸借対照表計上額	当中間期の損益に含まれた評価差額	中間貸借対照表計上額	当中間期の損益に含まれた評価差額
運用目的の金銭の信託	1,087	△ 0	1,208	28

(注) 上記目的以外の金銭の信託はありません。

デリバティブ取引情報

◇ 取引の状況に関する事項

●取引の内容

当行が行っているデリバティブ取引には、通貨関連では、為替予約取引、株式関連では、株価指数先物取引、株価指数オプション取引、株券オプション取引、債券関連では、債券先物取引及び債券店頭オプション取引があります。

●取引に対する取組方針

当行のデリバティブ取引は、お客さまのニーズに応じた商品の提供と保有資産及び負債に対する金利・為替等の変動リスクのコントロールを目的に取り組んでいるほか、一定のルールに従って運用益獲得目的による取引も行っております。

●取引の利用目的

当行は、主に金利や為替等の相場変動にさらされている資産に係るリスクを回避する目的としてデリバティブ取引を活用するとともに、短期的な売買についても一定の取引限度額を設定し取り組んでおります。また、外貨建債権債務については将来の為替や金利変動の回避及び外貨資金の安定調達を目的として通貨関連取引を利用しております。

●取引に係るリスクの内容及びリスク管理体制

デリバティブ取引には、市場リスクと信用リスクが存在します。市場リスクとは、取引対象物の価格等の変動により発生する可能性がある損失を指し、具体的には、金利関連取引における市場金利の変動によるリスクや、通貨関連取引における為替相場の変動によるリスク等が挙げられます。信用リスクとは、取引相手の契約不履行により発生する可能性がある損失を指します。

当行は、各運用資産の運用基準等規定に基づく取り扱いを行うとともに、上記リスクの把握とコントロールに努めております。デリバティブ取引においても規定に沿って各種取引のポジションコントロール、ALMにおけるヘッジに取り組むとともに担当部署が毎月リスク管理委員会に報告を行っております。

◇ 取引の時価等に関する事項

●金利関連取引

平成28年9月末及び平成29年9月末ともに該当ありません。

●通貨関連取引

(単位：百万円)

区分	種類		平成28年9月末				平成29年9月末			
			契約額等		時価	評価損益	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超							
店頭	為替 予約	売建	18,016	—	214	214	16,204	—	△ 307	△ 307
		買建	1,150	—	△ 19	△ 19	242	—	4	4
合計					195	195			△ 303	△ 303

(注) 1. 上記取引については時価評価を行い、評価損益を中間損益計算書に計上しております。
2. 時価の算定 割引現在価値等により算定しております。

●株式関連取引

平成28年9月末及び平成29年9月末ともに該当ありません。

●債券関連取引

平成28年9月末及び平成29年9月末ともに該当ありません。

●商品関連取引

平成28年9月末及び平成29年9月末ともに該当ありません。

●クレジットデリバティブ取引

平成28年9月末及び平成29年9月末ともに該当ありません。