

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、「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

2019年9月末及び2020年9月末ともに該当ありません。

●満期保有目的の債券

2019年9月末及び2020年9月末ともに該当ありません。

●その他有価証券

	種 類	2019年9月末			2020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	11,288	6,096	5,192	8,419	4,247	4,172
	債 券	169,899	165,751	4,147	131,599	129,426	2,173
	国 債	41,761	40,342	1,418	24,037	23,232	804
	地 方 債	8,886	8,683	203	3,760	3,637	123
	短 期 社 債	—	—	—	—	—	—
	社 債	119,250	116,724	2,525	103,802	102,556	1,245
	そ の 他	77,990	74,782	3,207	58,355	55,469	2,885
	外 国 債 券	48,498	47,489	1,008	36,159	35,032	1,126
	小 計	259,178	246,630	12,547	198,374	189,143	9,231
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	株 式	4,702	5,809	△ 1,107	4,898	6,186	△ 1,288
	債 券	9,256	9,306	△ 49	52,193	53,077	△ 883
	国 債	—	—	—	6,967	7,039	△ 71
	地 方 債	—	—	—	—	—	—
	短 期 社 債	—	—	—	—	—	—
	社 債	9,256	9,306	△ 49	45,225	46,037	△ 812
	そ の 他	30,876	32,489	△ 1,612	47,081	49,795	△ 2,713
	外 国 債 券	10,204	10,354	△ 149	18,889	19,128	△ 239
	小 計	44,834	47,604	△ 2,769	104,713	109,058	△ 4,885
合 計		304,013	294,235	9,777	302,548	298,202	4,345

(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

	2019年9月末	2020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	876	837
非 上 場 株 式	318	318
組 合 出 資 金	557	519
そ の 他 有 価 証 券	1,118	1,109
非 上 場 株 式	927	927
組 合 出 資 金	190	181

金銭の信託の時価等情報

(単位：百万円)

●売買目的有価証券

	2019年9月末		2020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	1,106	14	1,133	7

(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

2019年9月末及び2020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	2019年9月末			2020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			うち1年超		
店頭	為替	15,624	△ 159	△ 159	10,755	37	37
	売 建 買 建	2,335	8	8	85	△ 0	△ 0
合 計			△ 150	△ 150		36	36

(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

2019年9月末及び2020年9月末ともに該当ありません。

●債券関連取引

2019年9月末及び2020年9月末ともに該当ありません。

●商品関連取引

2019年9月末及び2020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

2019年9月末及び2020年9月末ともに該当ありません。