

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

2023年9月末及び2024年9月末ともに該当ありません。

●満期保有目的の債券

2023年9月末及び2024年9月末ともに該当ありません。

●その他有価証券

	種 類	2023年9月末			2024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	11,067	6,642	4,424	11,875	7,087	4,788
	債 券	26,119	25,747	371	34,689	34,252	436
	国 債	4,273	4,055	218	10,213	9,997	216
	地 方 債	1,068	1,019	48	1,041	1,013	28
	短 期 社 債	—	—	—	—	—	—
	社 債	20,777	20,672	104	23,433	23,241	192
	そ の 他	24,473	21,875	2,597	19,499	17,398	2,101
	外 国 債 券	11,348	11,307	40	8,968	8,906	61
	小 計	61,659	54,265	7,393	66,064	58,738	7,325
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	株 式	2,736	3,189	△ 452	3,499	3,955	△ 455
	債 券	179,226	184,890	△ 5,663	197,489	204,087	△ 6,598
	国 債	5,609	5,936	△ 326	4,629	4,943	△ 314
	地 方 債	2,929	3,000	△ 70	3,236	3,300	△ 63
	短 期 社 債	—	—	—	—	—	—
	社 債	170,688	175,954	△ 5,266	189,623	195,844	△ 6,220
	そ の 他	49,111	53,579	△ 4,468	36,929	39,265	△ 2,335
	外 国 債 券	29,136	30,154	△ 1,017	20,870	21,021	△ 151
	小 計	231,074	241,659	△ 10,584	237,918	247,308	△ 9,389
	合 計	292,734	295,924	△ 3,190	303,983	306,047	△ 2,063

(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。

●市場価格のない有価証券の主な内容及び中間貸借対照表計上額

	2023年9月末	2024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	1,026	1,075
非 上 場 株 式	418	518
組 合 出 資 金	607	556
そ の 他 有 価 証 券	1,321	1,530
非 上 場 株 式	846	946
組 合 出 資 金	474	583

金銭の信託の時価等情報

(単位：百万円)

●売買目的有価証券

	2023年9月末		2024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	1,113	4	1,001	—

(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

2023年9月末及び2024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	2023年9月末				2024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	13,106	—	△359	△359	6,201	—	93	93
	売建 買建	79	—	5	5	283	—	△1	△1
合 計				△353	△353			91	91

(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

2023年9月末及び2024年9月末ともに該当ありません。

●債券関連取引

2023年9月末及び2024年9月末ともに該当ありません。

●商品関連取引

2023年9月末及び2024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

2023年9月末及び2024年9月末ともに該当ありません。

電子決済手段

2023年9月末及び2024年9月末ともに該当ありません。