

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

2024年9月末及び2025年9月末ともに該当ありません。

●満期保有目的の債券

	種 類	2024年9月末			2025年9月末		
		中間貸借対照表計上額	時 価	差 額	中間貸借対照表計上額	時 価	差 額
時価が中間貸借対照表計上額を超えるもの	債 券	—	—	—	—	—	—
	国 債	—	—	—	—	—	—
	地 方 債	—	—	—	—	—	—
	短 期 社 債	—	—	—	—	—	—
	社 債	—	—	—	—	—	—
	そ の 他	—	—	—	—	—	—
	外 国 債 券	—	—	—	—	—	—
小 計		—	—	—	—	—	—
時価が中間貸借対照表計上額を超えないもの	債 券	—	—	—	11,262	11,150	△112
	国 債	—	—	—	—	—	—
	地 方 債	—	—	—	962	947	△14
	短 期 社 債	—	—	—	—	—	—
	社 債	—	—	—	10,300	10,202	△97
	そ の 他	—	—	—	—	—	—
	外 国 債 券	—	—	—	—	—	—
小 計		—	—	—	11,262	11,150	△112
合 計		—	—	—	11,262	11,150	△112

●その他有価証券

	種 類	2024年9月末			2025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	11,875	7,087	4,788	15,822	9,529	6,292
	債 券	34,689	34,252	436	7,711	7,538	173
	国 債	10,213	9,997	216	3,080	3,023	56
	地 方 債	1,041	1,013	28	1,017	1,007	9
	短 期 社 債	—	—	—	—	—	—
	社 債	23,433	23,241	192	3,614	3,507	106
	そ の 他	19,499	17,398	2,101	24,054	21,170	2,883
	外 国 債 券	8,968	8,906	61	7,824	7,725	98
小 計		66,064	58,738	7,325	47,588	38,238	9,349
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	株 式	3,499	3,955	△ 455	2,370	2,587	△ 216
	債 券	197,489	204,087	△ 6,598	206,150	220,987	△ 14,836
	国 債	4,629	4,943	△ 314	24,078	25,300	△ 1,222
	地 方 債	3,236	3,300	△ 63	2,401	2,500	△ 98
	短 期 社 債	—	—	—	6,994	6,994	△ 0
	社 債	189,623	195,844	△ 6,220	172,676	186,191	△ 13,515
	そ の 他	36,929	39,265	△ 2,335	40,735	42,027	△ 1,292
	外 国 債 券	20,870	21,021	△ 151	30,322	30,750	△ 428
小 計		237,918	247,308	△ 9,389	249,256	265,602	△ 16,345
合 計		303,983	306,047	△ 2,063	296,845	303,840	△ 6,995

(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

	2024年9月末	2025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	1,075	1,014
非 上 場 株 式	518	518
組 合 出 資 金	556	495
そ の 他 有 価 証 券	1,530	1,536
非 上 場 株 式	946	946
組 合 出 資 金	583	590

金銭の信託の時価等情報

(単位：百万円)

●売買目的有価証券

	2024年9月末		2025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	1,001	—	1,007	△0

(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

2024年9月末及び2025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	2024年9月末				2025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 予約	6,201	—	93	93	6,156	—	△148	△148
	売 建 買 建	283	—	△1	△1	96	—	0	0
合 計				91	91			△148	△148

(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

2024年9月末及び2025年9月末ともに該当ありません。

●債券関連取引

2024年9月末及び2025年9月末ともに該当ありません。

●商品関連取引

2024年9月末及び2025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

2024年9月末及び2025年9月末ともに該当ありません。

電子決済手段

2024年9月末及び2025年9月末ともに該当ありません。