

時価情報

◎売買目的有価証券

該当ありません。

◎満期保有目的の債券で時価のあるもの

[単位：百万円]

		貸借対照表 計上額	時価	差額	うち益	うち損
地方債	平成20年3月31日	13,275	13,551	276	276	—
	平成21年3月31日	12,059	12,283	224	224	—
社債	平成20年3月31日	14,740	14,874	133	134	0
	平成21年3月31日	11,580	11,654	73	88	15
その他	平成20年3月31日	7,992	7,766	△226	—	226
	平成21年3月31日	7,996	7,621	△374	—	374
合計	平成20年3月31日	36,008	36,192	183	410	227
	平成21年3月31日	31,636	31,559	△76	313	390

[注] 時価は、平成21年3月期末日における市場価格等に基づいております。

◎その他有価証券で時価のあるもの

[単位：百万円]

		取得原価	貸借対照表 計上額	評価差額	うち益	うち損
株式	平成20年3月31日	22,151	25,548	3,397	5,066	1,669
	平成21年3月31日	20,467	19,444	△1,023	3,266	4,290
債券	平成20年3月31日	150,060	147,988	△2,072	570	2,643
	平成21年3月31日	160,654	162,916	2,261	3,286	1,024
国債	平成20年3月31日	122,468	120,204	△2,263	369	2,632
	平成21年3月31日	121,262	123,963	2,700	2,756	56
地方債	平成20年3月31日	7,617	7,720	102	103	0
	平成21年3月31日	18,982	19,442	460	460	—
社債	平成20年3月31日	19,975	20,063	88	98	9
	平成21年3月31日	20,409	19,510	△899	69	968
その他	平成20年3月31日	14,998	13,927	△1,070	350	1,421
	平成21年3月31日	11,018	10,734	△283	152	435
合計	平成20年3月31日	187,210	187,464	254	5,988	5,733
	平成21年3月31日	192,140	193,095	954	6,705	5,750

[注] 貸借対照表計上額は、平成21年3月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。

◎当期中に売却したその他有価証券

[単位：百万円]

	平成20年3月期			平成21年3月期		
	売却額	売却益	売却損	売却額	売却益	売却損
その他有価証券	203,206	2,892	2,414	198,032	2,933	4,675

◎時価のない有価証券の主な内容及び貸借対照表計上額

[単位：百万円]

		平成20年3月31日	平成21年3月31日
満期保有目的の債券	私募事業債	1,650	1,650
子会社・子法人等株式及び関連法人等株式	子会社株式	1,405	1,329
その他有価証券	非上場株式（店頭売買株式を除く）	1,289	1,266
その他有価証券	出資金	572	588

[注] その他有価証券出資金は金融商品取引法第2条に基づくみなし有価証券として平成19年3月期より有価証券として区分しています。

◎その他有価証券のうち満期があるもの及び満期保有目的の債券の償還予定額

[単位：百万円]

		1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
債券	平成20年3月31日	21,657	64,672	17,010	74,313
	平成21年3月31日	14,126	58,199	47,448	68,431
国債	平成20年3月31日	7,036	27,313	11,540	74,313
	平成21年3月31日	3,952	18,114	33,464	68,431
地方債	平成20年3月31日	4,294	12,245	4,456	—
	平成21年3月31日	5,148	13,368	12,984	—
社債	平成20年3月31日	10,326	25,113	1,013	—
	平成21年3月31日	5,025	26,716	1,000	—
その他	平成20年3月31日	440	10,929	2,857	300
	平成21年3月31日	6,981	7,660	270	353
合計	平成20年3月31日	22,097	75,602	19,868	74,613
	平成21年3月31日	21,107	65,859	47,719	68,785

◎金銭の信託関係

該当ありません。

(その他有価証券評価差額金)

貸借対照表に計上されているその他有価証券評価差額金の内訳は、次のとおりであります。

[単位：百万円]

	平成20年3月31日	平成21年3月31日
評価差額	254	954
その他有価証券	254	954
(△) 繰延税金負債	△101	△379
その他有価証券評価差額金	152	574

◎デリバティブ取引関係

1. 取引の状況に関する事項

(平成20年4月1日から平成21年3月31日まで)

(1) 取引の内容

当行が利用しているデリバティブ取引は、金利関連取引では金利スワップ取引、通貨関連取引では為替スワップ、先物為替予約取引であります。なお、債券関連取引、株式関連取引、商品関連取引、及びクレジットデリバティブ取引は取扱がありません。

(2) 取引に対する取組方針

当行は、貸出金、有価証券等にかかる市場性リスクの回避を主目的としてデリバティブ取引を活用することとし、短期的な売買差益を獲得する目的(トレーディング目的)の取引は一定のポジション限度や損失限度を設定して取り組んでいく方針であります。

(3) 取引の利用目的

当行は、貸出金、有価証券等固定金利運用に対する調達資金の金利上昇リスクを回避する目的で、金利スワップ取引を行っております。また、流動性対策として外貨資金の安定調達のため為替スワップ取引を利用しております。なお、デリバティブ取引を利用してヘッジ会計を行っております。

(ヘッジ会計の方法) 繰延ヘッジ処理によっております。

(ヘッジ手段) 金利スワップを用いております。

(ヘッジ対象) 貸出金等の金利感応資産を対象としております。

(ヘッジ方針)

リスクの低減を図るため必要に応じたヘッジ施策を適宜・適切に実行することを基本方針とし、金利リスク低減のため、対象資産の範囲内でヘッジを行っております。

(ヘッジ有効性評価の方法)

リスク管理方針に定められた許容リスク量の範囲内にリスク調整手段となるデリバティブのリスク量が収まっており、ヘッジ対象の金利リスクが減殺されているかどうかを検証することにより有効性を評価しております。

(4) 取引に係るリスクの内容

デリバティブ取引は、金利・為替・価格変動などの市場の変化により損失が発生する市場性リスクを有しています。また、金利スワップ、為替スワップ取引等の店頭取引は市場性リスクのほか、取引相手方の破綻により取引が履行されなくなる信用リスクを有しておりますが、信用度の高い金融機関との取引に限定し、かつ取引先毎に与信限度枠の設定・管理を行い、リスクの極小化に努めております。

(5) 取引に係るリスク管理体制

当行では、主に市場性リスクを回避する目的でデリバティブ取引を活用し、リスク管理の状況については毎月リスク管理委員会へ報告を行うとともに定期的に経営陣に報告する体制を構築しています。

なお、市場部門の組織はフロントオフィスとバックオフィスとを厳格に分離するとともに、ミドルオフィスを設置し、相互牽制の徹底を図っています。

(6) 取引の時価等に関する事項についての補足説明

デリバティブ取引にかかる「契約額等」は名目上の契約額又は計算上想定している元本で、その金額自体がリスク額を意味するものではありません。

2. 取引の時価等に関する事項

(1) 金利関連取引（平成21年3月31日現在）

該当事項なし。

(2) 通貨関連取引（平成21年3月31日現在）

[単位：百万円]

	種類	契約額等	契約額等のうち 1年超のもの	時価	評価損益
店頭	通貨スワップ 為替予約				
	売建	682	—	△43	△43
	買建	499	—	39	39
	通貨オプション				
	売建				
	買建				
	その他				
	売建				
	買建				
	合計	—	—	3	3

[注] 1. 上記取引については時価評価を行い、評価損益を損益計算書に計上しております。なお、「銀行業における外貨建取引等の会計処理に関する会計上及び監査上の取扱い」(日本公認会計士協会業種別監査委員会報告第25号)等に基づきヘッジ会計を適用している通貨スワップ取引等及び外貨建金銭債権債務等に付されたもので当該外貨建金銭債権債務等の貸借対照表表示に反映されているものについては、上記記載から除いております。

2. 時価の算定：割引現在価値等により算定しております。

3. 金融商品取引所取引につきましては、該当事項ありません。

(3) 株式関連取引（平成21年3月31日現在）

該当事項なし。

(4) 債券関連取引（平成21年3月31日現在）

該当事項なし。

(5) 商品関連取引（平成21年3月31日現在）

該当事項なし。

(6) クレジットデリバティブ取引（平成21年3月31日現在）

該当事項なし。