

営業の状況

【預金】

●預金科目別残高

[中間期末残高]

(単位：百万円、%)

		2020年9月30日			2021年9月30日		
		国内業務部門	国際業務部門	合 計	国内業務部門	国際業務部門	合 計
預金	流動性預金	5,261,733 (69.78)	49 (0.06)	5,261,782 (69.05)	5,650,543 (72.01)	69 (0.06)	5,650,612 (70.97)
	うち有利息預金	4,939,246	—	4,939,246	5,321,996	—	5,321,996
	定期性預金	1,967,168 (26.09)	8,194 (10.28)	1,975,363 (25.92)	1,915,690 (24.42)	28,241 (24.41)	1,943,931 (24.41)
	うち固定金利定期預金	1,963,847	8,194	1,972,041	1,914,405	28,241	1,942,646
	うち変動金利定期預金	912	—	912	856	—	856
	その他	76,594 (1.01)	50,318 (63.12)	126,912 (1.67)	73,776 (0.94)	53,803 (46.51)	127,580 (1.60)
	合計	7,305,496 (96.88)	58,562 (73.46)	7,364,058 (96.64)	7,640,009 (97.37)	82,114 (70.98)	7,722,124 (96.98)
譲渡性預金		235,022 (3.12)	21,160 (26.54)	256,182 (3.36)	206,518 (2.63)	33,576 (29.02)	240,094 (3.02)
総合計		7,540,518 (100.00)	79,722 (100.00)	7,620,241 (100.00)	7,846,528 (100.00)	115,690 (100.00)	7,962,218 (100.00)

[平均残高]

(単位：百万円、%)

		2020年度中間期 (2020年4月1日から2020年9月30日まで)			2021年度中間期 (2021年4月1日から2021年9月30日まで)		
		国内業務部門	国際業務部門	合 計	国内業務部門	国際業務部門	合 計
預金	流動性預金	5,129,699 (69.43)	85 (0.12)	5,129,784 (68.79)	5,658,102 (72.30)	98 (0.10)	5,658,201 (71.41)
	うち有利息預金	4,825,516	—	4,825,516	5,331,646	—	5,331,646
	定期性預金	1,957,395 (26.50)	8,916 (12.80)	1,966,312 (26.37)	1,916,061 (24.48)	23,831 (24.59)	1,939,893 (24.48)
	うち固定金利定期預金	1,953,947	8,916	1,962,864	1,913,757	23,831	1,937,588
	うち変動金利定期預金	918	—	918	865	—	865
	その他	42,106 (0.57)	31,299 (44.94)	73,406 (0.98)	40,471 (0.52)	39,277 (40.52)	79,748 (1.01)
	合計	7,129,201 (96.50)	40,301 (57.86)	7,169,502 (96.14)	7,614,635 (97.30)	63,207 (65.21)	7,677,842 (96.90)
譲渡性預金		258,842 (3.50)	29,352 (42.14)	288,194 (3.86)	211,685 (2.70)	33,728 (34.79)	245,414 (3.10)
総合計		7,388,044 (100.00)	69,653 (100.00)	7,457,697 (100.00)	7,826,320 (100.00)	96,936 (100.00)	7,923,256 (100.00)

- (注) 1. () 内は構成比であります。
2. 流動性預金＝当座預金＋普通預金＋貯蓄預金＋通知預金
3. 定期性預金＝定期預金＋定期積金
4. 国際業務部門の国内店外貨建取引の平均残高は、日次カレント方式により算出しております。
5. 外貨預金は、流動性・定期性とも「その他」に含めております。

●定期預金の残存期間別残高

(単位：百万円)

	期間	3ヵ月未満	3ヵ月以上 6ヵ月未満	6ヵ月以上 1年未満	1年以上 2年未満	2年以上 3年未満	3年以上	合 計
	期別							
定期預金	2020年9月30日	508,192	387,810	624,946	223,365	183,318	45,321	1,972,954
	2021年9月30日	514,465	384,106	604,351	210,385	193,863	36,329	1,943,502
固定金利定期預金	2020年9月30日	508,033	387,624	624,564	223,233	183,265	45,321	1,972,041
	2021年9月30日	514,320	383,925	604,054	210,318	193,697	36,329	1,942,646
変動金利定期預金	2020年9月30日	158	186	381	132	53	—	912
	2021年9月30日	144	181	297	66	166	—	856

●預金者別預金残高

(単位：百万円、%)

	2020年9月30日	2021年9月30日
個人預金	5,253,088 (71.41)	5,450,747 (70.85)
法人預金	1,794,626 (24.40)	1,893,532 (24.61)
その他	308,099 (4.19)	349,534 (4.54)
合計	7,355,814 (100.00)	7,693,813 (100.00)

- (注) 1. () 内は構成比であります。
2. その他は公金預金、金融機関預金であります。
3. 譲渡性預金及び海外店分は含んでおりません。

【貸出金】

●貸出金科目別残高

[中間期末残高]

(単位：百万円)

	2020年9月30日			2021年9月30日		
	国内業務部門	国際業務部門	合 計	国内業務部門	国際業務部門	合 計
手形貸付	98,442	1,687	100,129	92,368	1,154	93,522
証書貸付	4,851,195	187,823	5,039,019	4,887,710	195,130	5,082,841
当座貸越	542,187	—	542,187	536,313	—	536,313
割引手形	21,061	—	21,061	21,244	—	21,244
合計	5,512,887	189,510	5,702,398	5,537,636	196,285	5,733,921

[平均残高]

(単位：百万円)

	2020年度中間期 (2020年4月1日から2020年9月30日まで)			2021年度中間期 (2021年4月1日から2021年9月30日まで)		
	国内業務部門	国際業務部門	合 計	国内業務部門	国際業務部門	合 計
手形貸付	100,106	1,705	101,811	89,643	1,178	90,821
証書貸付	4,787,691	194,064	4,981,755	4,885,569	189,729	5,075,298
当座貸越	527,499	—	527,499	507,859	—	507,859
割引手形	23,760	—	23,760	20,843	—	20,843
合計	5,439,058	195,769	5,634,827	5,503,915	190,908	5,694,823

(注) 国際業務部門の国内店外貸建取引の平均残高は、日次カレント方式により算出しております。

●貸出金の残存期間別残高

(単位：百万円)

	期別	期間						合 計
		1年以下	1年超 3年以下	3年超 5年以下	5年超 7年以下	7年超	期限の定め のないもの	
貸出金	2020年9月30日	1,347,613	987,661	726,935	458,943	2,145,288	35,955	5,702,398
	2021年9月30日	1,356,246	971,856	721,736	486,119	2,160,102	37,860	5,733,921
変動金利	2020年9月30日	—	589,512	391,436	242,208	1,200,624	161	—
	2021年9月30日	—	562,083	369,997	247,270	1,234,967	154	—
固定金利	2020年9月30日	—	398,149	335,499	216,734	944,663	35,794	—
	2021年9月30日	—	409,772	351,738	238,848	925,135	37,706	—

(注) 1. 残存期間1年以下の貸出金については、変動金利、固定金利の区分をしておりません。

2. 当初固定金利で一定期間後に金利を見直す住宅ローンについて、固定金利期間にあるものは「うち固定金利」に区分し、期間は最終返済期日で区分しております。

●中小企業等に対する貸出金

(単位：百万円)

	2020年9月30日	2021年9月30日
総貸出金残高 (A)	5,650,268	5,671,770
うち中小企業等貸出金残高 (B)	4,796,584	4,773,392
割合 $\frac{(B)}{(A)}$ (%)	84.89	84.16

(注) 1. 貸出金残高には、海外店分、特別国際金融取引勘定及び中央政府向け貸出は含まれておりません。

2. 中小企業等とは、資本金3億円（ただし、卸売業は1億円、小売業、飲食業、物品賃貸業等は5千万円）以下の会社又は常用する従業員が300人（ただし、卸売業、物品賃貸業等は100人、小売業、飲食業は50人）以下の企業等であります。

●業種別貸出状況

(単位：百万円、%)

	2020年9月30日	2021年9月30日
	貸出金残高	貸出金残高
国内店計（除く特別国際金融取引勘定）	5,650,268 (100.00)	5,671,770 (100.00)
製造業	728,581 (12.89)	698,879 (12.32)
農業、林業	9,264 (0.16)	8,821 (0.16)
漁業	1,603 (0.03)	2,102 (0.04)
鉱業、採石業、砂利採取業	3,780 (0.07)	3,935 (0.07)
建設業	191,708 (3.39)	201,600 (3.55)
電気・ガス・熱供給・水道業	71,463 (1.27)	73,603 (1.30)
情報通信業	25,883 (0.46)	25,228 (0.44)
運輸業、郵便業	153,929 (2.72)	161,387 (2.84)
卸売業、小売業	457,818 (8.10)	461,459 (8.14)
金融業、保険業	168,005 (2.97)	166,899 (2.94)
不動産業、物品賃貸業	729,271 (12.91)	731,429 (12.90)
医療・福祉	340,796 (6.03)	335,581 (5.92)
その他サービス業	275,715 (4.88)	272,811 (4.81)
地方公共団体	84,558 (1.50)	108,839 (1.92)
その他	2,407,882 (42.62)	2,419,185 (42.65)
海外店分及び特別国際金融取引勘定分	52,129 (100.00)	62,151 (100.00)
政府等	— (—)	— (—)
金融機関	— (—)	— (—)
その他	52,129 (100.00)	62,151 (100.00)
合計	5,702,398	5,733,921

(注) 1. () 内は構成比であります。
2. その他には、個人向け貸出を含んでおります。

●貸出金・支払承諾見返の担保別内訳

(単位：百万円)

	2020年9月30日		2021年9月30日	
	貸出金	支払承諾見返	貸出金	支払承諾見返
有価証券	8,324	—	7,892	—
債権	62,358	638	65,323	722
不動産	2,750,225	1,049	2,731,374	1,040
その他	7,473	485	5,819	320
計	2,828,382	2,174	2,810,409	2,083
保証	1,271,255	3,870	1,280,171	2,596
信用	1,602,761	4,260	1,643,340	4,315
合計	5,702,398	10,304	5,733,921	8,995

●貸出金使途別内訳

(単位：百万円、%)

	2020年9月30日	2021年9月30日
設備資金	3,365,010 (59.01)	3,342,027 (58.29)
運転資金	2,337,388 (40.99)	2,391,893 (41.71)
合計	5,702,398 (100.00)	5,733,921 (100.00)

(注) () 内は構成比であります。

●貸倒引当金の中間期末残高及び期中の増減額

(単位：百万円)

		期首残高	期中増減額	中間期末残高
一般貸倒引当金	2020年9月30日	13,216	4,333	17,549
	2021年9月30日	27,776	△10,815	16,961
個別貸倒引当金	2020年9月30日	27,061	330	27,392
	2021年9月30日	29,393	△445	28,948
特定海外債権引当勘定	2020年9月30日	—	—	—
	2021年9月30日	—	—	—
合計	2020年9月30日	40,278	4,663	44,942
	2021年9月30日	57,170	△11,260	45,910

●貸出金償却額

(単位：百万円)

	2020年9月30日	2021年9月30日
貸出金償却額	—	6

(注) 個別貸倒引当金の目的使用による取崩額を控除した後の金額を記載しております。

●特定海外債権残高

該当事項はありません。

●リスク管理債権

(単位：百万円)

	2020年9月30日	2021年9月30日
破綻先債権額	10,077	8,913
延滞債権額	57,338	62,490
3ヵ月以上延滞債権額	2,245	2,178
貸出条件緩和債権額	43,984	46,374
合計	113,645	119,955

(注) 1. 「破綻先債権」とは、元本又は利息の支払の遅延が相当期間継続していることその他の事由により元本又は利息の取立て又は弁済の見込みがないものとして未収利息を計上しなかった貸出金（貸倒償却を行った部分を除く。以下「未収利息不計上貸出金」という。）のうち、法人税法施行令（1965年政令第97号）第96条第1項第3号イからホまでに掲げる事由又は同項第4号に規定する事由が生じている貸出金をいいます。
2. 「延滞債権」とは、未収利息不計上貸出金であって、破綻先債権及び債務者の経営再建又は支援を図ることを目的として利息の支払を猶予した貸出金以外の貸出金をいいます。
3. 「3ヵ月以上延滞債権」とは、元本又は利息の支払が約定支払日の翌日から3ヵ月以上遅延している貸出金で破綻先債権及び延滞債権に該当しないものをいいます。
4. 「貸出条件緩和債権」とは、債務者の経営再建又は支援を図ることを目的として、金利の減免、利息の支払猶予、元本の返済猶予、債権放棄その他の債務者に有利となる取決めを行った貸出金で破綻先債権、延滞債権及び3ヵ月以上延滞債権に該当しないものをいいます。

【金融再生法に基づく開示債権】

(単位：百万円)

	2020年9月30日	2021年9月30日
破産更生債権及びこれらに準ずる債権	28,220	28,026
危険債権	39,303	43,438
要管理債権	46,229	48,552
正常債権	5,679,291	5,694,381
合計	5,793,045	5,814,398

(注) その他資産中の未収利息及び仮払金については、貸出関連の資産項目を集計しております。

○資産の査定は、「金融機能の再生のための緊急措置に関する法律」（1998年法律第132号）第6条に基づき、当行の中間貸借対照表の社債（当該社債を有する金融機関がその元本の償還及び利息の支払の全部又は一部について保証しているものであって、当該社債の発行が金融商品取引法（1948年法律第25号）第2条第3項に規定する有価証券の私募によるものに限る。）、貸出金、外国為替、その他資産中の未収利息及び仮払金、支払承諾見返の各勘定に計上されるもの並びに中間貸借対照表に注記することとされている有価証券の貸付けを行っている場合のその有価証券（使用貸借又は賃貸借契約によるものに限る。）について債務者の財政状態及び経営成績等を基礎として次のとおり区分するものであります。

1. 破産更生債権及びこれらに準ずる債権
破産更生債権及びこれらに準ずる債権とは、破産手続開始、更生手続開始、再生手続開始の申立て等の事由により経営破綻に陥っている債務者に対する債権及びこれらに準ずる債権をいいます。
2. 危険債権
危険債権とは、債務者が経営破綻の状態には至っていないが、財政状態及び経営成績が悪化し、契約に従った債権の元本の回収及び利息の受取りができない可能性の高い債権をいいます。
3. 要管理債権
要管理債権とは、3ヵ月以上延滞債権及び貸出条件緩和債権をいいます。
4. 正常債権
正常債権とは、債務者の財政状態及び経営成績に特に問題がないものとして、上記1.から3.までに掲げる債権以外のものに区分される債権をいいます。

【証券】

●有価証券残高

[中間期末残高]

(単位：百万円、%)

	2020年9月30日			2021年9月30日		
	国内業務部門	国際業務部門	合 計	国内業務部門	国際業務部門	合 計
国債	447,447 (25.54)	— (—)	447,447 (22.88)	839,953 (38.33)	— (—)	839,953 (33.89)
地方債	720,363 (41.13)	— (—)	720,363 (36.84)	751,612 (34.29)	— (—)	751,612 (30.32)
社債	208,321 (11.89)	— (—)	208,321 (10.65)	201,056 (9.17)	— (—)	201,056 (8.11)
株式	157,891 (9.01)	— (—)	157,891 (8.08)	222,172 (10.14)	— (—)	222,172 (8.96)
その他の証券	217,633 (12.43)	203,746 (100.00)	421,380 (21.55)	176,812 (8.07)	287,241 (100.00)	464,053 (18.72)
うち外国債券	—	183,084	183,084	—	257,205	257,205
うち外国株式	—	3,202	3,202	—	—	—
合計	1,751,657 (100.00)	203,746 (100.00)	1,955,404 (100.00)	2,191,607 (100.00)	287,241 (100.00)	2,478,848 (100.00)

[平均残高]

(単位：百万円、%)

	2020年度中間期 (2020年4月1日から2020年9月30日まで)			2021年度中間期 (2021年4月1日から2021年9月30日まで)		
	国内業務部門	国際業務部門	合 計	国内業務部門	国際業務部門	合 計
国債	385,739 (23.96)	— (—)	385,739 (21.63)	780,554 (38.13)	— (—)	780,554 (33.49)
地方債	711,321 (44.18)	— (—)	711,321 (39.88)	746,779 (36.48)	— (—)	746,779 (32.04)
社債	209,632 (13.02)	— (—)	209,632 (11.75)	205,582 (10.05)	— (—)	205,582 (8.82)
株式	77,542 (4.82)	— (—)	77,542 (4.35)	134,719 (6.58)	— (—)	134,719 (5.78)
その他の証券	225,785 (14.02)	173,495 (100.00)	399,280 (22.39)	179,318 (8.76)	283,682 (100.00)	463,001 (19.87)
うち外国債券	—	154,489	154,489	—	256,940	256,940
うち外国株式	—	3,202	3,202	—	2,712	2,712
合計	1,610,021 (100.00)	173,495 (100.00)	1,783,516 (100.00)	2,046,954 (100.00)	283,682 (100.00)	2,330,636 (100.00)

(注) 1. () 内は構成比であります。

2. 国際業務部門の国内店外貨建取引の平均残高は、日次カレント方式により算出しております。

●有価証券の残存期間別残高

(単位：百万円)

	期別	期間						期間の定め のないもの	合 計
		1年以下	1年超 3年以下	3年超 5年以下	5年超 7年以下	7年超 10年以下	10年超		
国債	2020年9月30日	59,584	67,591	—	—	71,408	248,862	—	447,447
	2021年9月30日	64,831	2,031	—	—	226,475	546,615	—	839,953
地方債	2020年9月30日	76,230	146,539	126,612	117,060	246,913	7,006	—	720,363
	2021年9月30日	71,992	146,921	132,885	153,075	240,735	6,001	—	751,612
社債	2020年9月30日	26,014	38,705	19,528	9,780	114,292	—	—	208,321
	2021年9月30日	24,296	34,198	17,000	10,434	115,127	—	—	201,056
株式	2020年9月30日	—	—	—	—	—	—	157,891	157,891
	2021年9月30日	—	—	—	—	—	—	222,172	222,172
その他の証券	2020年9月30日	8,214	52,402	33,505	18,270	153,731	77,136	78,119	421,380
	2021年9月30日	23,151	61,065	26,738	30,811	95,212	156,706	70,367	464,053
うち外国債券	2020年9月30日	7,923	32,478	16,699	—	52,959	73,023	—	183,084
	2021年9月30日	15,953	40,010	4,903	9,349	40,448	146,540	—	257,205
うち外国株式	2020年9月30日	—	—	—	—	—	—	3,202	3,202
	2021年9月30日	—	—	—	—	—	—	—	—

●商品有価証券平均残高

(単位：百万円)

	2020年度中間期 (2020年4月1日から2020年9月30日まで)	2021年度中間期 (2021年4月1日から2021年9月30日まで)
商品国債	343	380
商品地方債	472	479
その他の商品有価証券	103	—
合計	919	860

【信託】

●信託業務の状況

(単位：百万円)

	2019年9月	2020年9月	2021年9月	2020年3月	2021年3月
信託報酬	24	30	25	36	53
信託勘定貸出金残高	—	—	—	—	—
信託勘定有価証券残高 (信託勘定電子記録移転有価証券表示権利等残高を除く。)	—	—	—	—	—
信託勘定電子記録移転有価証券 表示権利等残高	—	—	—	—	—
信託財産額	4,157	7,475	10,605	4,899	8,953

●信託財産残高表

(単位：百万円)

資 産	2020年9月30日	2021年9月30日	負 債	2020年9月30日	2021年9月30日
銀行勘定貸	7,475	10,605	金銭信託	7,475	10,605
合計	7,475	10,605	合計	7,475	10,605

(注) 共同信託他社管理財産については、取扱残高はありません。

●元本補填契約のある信託の種類別受託残高

(単位：百万円)

資 産	2020年9月30日	2021年9月30日	負 債	2020年9月30日	2021年9月30日
銀行勘定貸	7,475	10,605	元本	7,475	10,605
合計	7,475	10,605	合計	7,475	10,605

●金銭信託

[受託残高]

(単位：百万円)

	2020年9月30日	2021年9月30日
金銭信託	7,475	10,605

[信託期間別元本残高]

(単位：百万円)

	2020年9月30日	2021年9月30日
5年未満	334	406
5年以上	7,140	10,199
その他のもの	—	—
合計	7,475	10,605

(注) 以下の事項についても該当するものではありません。

1. 年金信託、財産形成給付信託、貸付信託の受託残高
2. 金銭信託、年金信託、財産形成給付信託、貸付信託の有価証券種類別残高
3. 元本補填契約のある信託に係る貸出金のうち破綻先債権、延滞債権、3ヵ月以上延滞債権及び貸出条件緩和債権に該当するものの額並びにその合計額
4. 貸付信託の信託期間別元本残高
5. 貸出金及び有価証券の区分別運用残高
6. 金銭信託、年金信託、財産形成給付信託、貸付信託の①貸出金運用残高及び②貸出金の科目別・契約期間別・使途別・担保種類別残高及び③中小企業等貸出金残高・中小企業等貸出金割合・業種別貸出金残高・業種別貸出金割合

【有価証券・金銭の信託の時価情報】

●有価証券関係

※中間貸借対照表の「有価証券」のほか、「買入金銭債権」中の信託受益権を含めて記載しております。

1. 満期保有目的の債券

(単位：百万円)

	種類	2020年9月30日			2021年9月30日		
		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	国債	—	—	—	—	—	—
	地方債	—	—	—	—	—	—
	社債	2,355	2,382	27	2,162	2,186	24
	その他	—	—	—	—	—	—
	小計	2,355	2,382	27	2,162	2,186	24
時価が中間貸借対照表計上額を超えないもの	国債	—	—	—	—	—	—
	地方債	—	—	—	—	—	—
	社債	—	—	—	50	49	△0
	その他	—	—	—	—	—	—
	小計	—	—	—	50	49	△0
合計		2,355	2,382	27	2,212	2,236	24

2. 子会社・子法人等株式及び出資金並びに関連法人等株式

2020年9月30日現在及び2021年9月30日現在ともに、該当事項はありません。

(注) 市場価格のない子会社・子法人等株式及び出資金並びに関連法人等株式

(単位：百万円)

種類	2020年9月30日	2021年9月30日
	中間貸借対照表計上額	中間貸借対照表計上額
子会社・子法人等株式及び出資金	11,290	8,629
関連法人等株式	103	103

これらについては、市場価格がないことから、上表の「子会社・子法人等株式及び出資金並びに関連法人等株式」には含めておりません。

3. その他有価証券

(単位：百万円)

	種類	2020年9月30日			2021年9月30日		
		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	106,968	37,920	69,047	184,433	98,172	86,261
	債券	1,123,039	1,113,648	9,391	1,419,786	1,411,561	8,224
	国債	307,995	305,641	2,354	581,389	578,755	2,633
	地方債	652,972	647,390	5,581	672,497	668,183	4,314
	社債	162,071	160,616	1,455	165,898	164,622	1,276
	その他	274,863	262,478	12,384	291,368	274,893	16,474
	外国債券	140,383	135,899	4,483	132,806	129,758	3,048
	その他	134,480	126,579	7,900	158,561	145,135	13,426
	小計	1,504,870	1,414,046	90,823	1,895,588	1,784,628	110,960
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	株式	40,901	47,179	△6,277	26,710	29,603	△2,893
	債券	250,737	252,576	△1,838	370,623	372,395	△1,771
	国債	139,451	140,670	△1,218	258,563	259,910	△1,346
	地方債	67,391	67,556	△165	79,114	79,329	△214
	社債	43,894	44,349	△454	32,945	33,156	△210
	その他	143,002	154,687	△11,684	171,859	173,765	△1,905
	外国債券	42,701	42,787	△85	124,398	124,744	△345
	その他	100,300	111,899	△11,598	47,461	49,021	△1,559
	小計	434,641	454,443	△19,801	569,193	575,764	△6,570
合計		1,939,512	1,868,489	71,022	2,464,781	2,360,392	104,389

(注) 市場価格のないその他有価証券

(単位：百万円)

種類	2020年9月30日	2021年9月30日
	中間貸借対照表計上額	中間貸借対照表計上額
株式	2,214	3,121

上記については、市場価格がないため、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

●金銭の信託関係

1. 満期保有目的の金銭の信託

2020年9月30日現在及び2021年9月30日現在ともに、該当事項はありません。

2. その他の金銭の信託（運用目的及び満期保有目的以外）

2020年9月30日現在及び2021年9月30日現在ともに、該当事項はありません。

【デリバティブ取引情報】

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引について、取引の対象物の種類ごとの中間決算日における契約額又は契約において定められた元本相当額、時価及び評価損益は、次のとおりであります。なお、契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

[金利関連取引]

(単位：百万円)

区 分	種 類	2020年9月30日				2021年9月30日			
		契約額等	うち1年超	時 価	評価損益	契約額等	うち1年超	時 価	評価損益
金融商品取引所	金利先物	—	—	—	—	—	—	—	—
	金利オプション	—	—	—	—	—	—	—	—
店 頭	金利先渡契約	—	—	—	—	—	—	—	—
	金利スワップ	61,987	58,509	232	232	70,659	59,284	273	273
	受取固定・支払変動	30,993	29,254	318	318	35,329	29,642	362	362
	受取変動・支払固定	30,993	29,254	△86	△86	35,329	29,642	△89	△89
	受取変動・支払変動	—	—	—	—	—	—	—	—
	金利オプション	—	—	—	—	—	—	—	—
	その他	—	—	—	—	—	—	—	—
合計				232	232			273	273

(注) 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。

[通貨関連取引]

(単位：百万円)

区 分	種 類	2020年9月30日				2021年9月30日			
		契約額等	うち1年超	時 価	評価損益	契約額等	うち1年超	時 価	評価損益
金融商品取引所	通貨先物	—	—	—	—	—	—	—	—
	通貨オプション	—	—	—	—	—	—	—	—
店 頭	通貨スワップ	201,004	190,242	259	604	223,243	196,783	229	650
	為替予約	7,193	—	0	0	13,034	—	△30	△30
	売建	3,903	—	14	14	6,503	—	△116	△116
	買建	3,289	—	△13	△13	6,531	—	86	86
	通貨オプション	239,758	201,772	—	1,351	315,984	267,160	△56	1,756
	売建	119,879	100,886	△4,365	4,085	157,992	133,580	△4,574	4,239
	買建	119,879	100,886	4,365	△2,733	157,992	133,580	4,517	△2,482
	その他	—	—	—	—	—	—	—	—
合計				260	1,956			142	2,377

(注) 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。

[株式関連取引]

2020年9月30日現在及び2021年9月30日現在ともに、該当事項はありません。

[債券関連取引]

2020年9月30日現在及び2021年9月30日現在ともに、該当事項はありません。

[商品関連取引]

2020年9月30日現在及び2021年9月30日現在ともに、該当事項はありません。

[クレジットデリバティブ取引]

2020年9月30日現在及び2021年9月30日現在ともに、該当事項はありません。

[その他]

(単位：百万円)

区 分	種 類	2020年9月30日				2021年9月30日			
		契約額等	うち1年超	時 価	評価損益	契約額等	うち1年超	時 価	評価損益
店 頭	天候デリバティブ等	5,500	—	—	—	16,920	—	—	—
	売建	2,750	—	△37	—	8,460	—	△88	—
	買建	2,750	—	37	—	8,460	—	88	—
合計				—	—			—	—

ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引について、取引の対象物の種類ごと、ヘッジ会計の方法別の中間決算日における契約額又は契約において定められた元本相当額及び時価は、次のとおりであります。なお、契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

[金利関連取引]

(単位：百万円)

ヘッジ 会計の 方法	種 類	2020年9月30日				2021年9月30日			
		主なヘッジ 対象	契約額等	うち1年超	時 価	主なヘッジ 対象	契約額等	うち1年超	時 価
原則的 処理方法	金利スワップ	—	—	—	—	—	—	—	—
	金利先物		—	—	—		—	—	—
	金利オプション		—	—	—		—	—	—
	その他		—	—	—		—	—	—
金利 スワップの 特例処理	金利スワップ	貸出金	22,889	22,479	(注) 2	貸出金	23,891	15,481	(注) 2
	受取固定・支払変動		—	—			—	—	
	受取変動・支払固定		22,889	22,479			23,891	15,481	
合計					—				—

(注) 1. 主として業種別委員会実務指針第24号に基づき、繰延ヘッジにより処理することとしております。
2. 金利スワップの特例処理によるものは、ヘッジ対象とされている貸出金と一体として処理されているため、その時価は記載しておりません。

[通貨関連取引]

(単位：百万円)

ヘッジ会計の 方法	種 類	2020年9月30日				2021年9月30日			
		主なヘッジ 対象	契約額等	うち1年超	時 価	主なヘッジ 対象	契約額等	うち1年超	時 価
原則的 処理方法	通貨スワップ	外貨建の	116,380	42,320	1,976	外貨建の	134,304	67,152	△4,433
	為替予約	貸出金、	908	—	15	貸出金、	7,685	—	△97
	その他	有価証券	—	—	—	有価証券	—	—	—
為替予約等の 振当処理	通貨スワップ	—	—	—	—	—	—	—	—
	為替予約		—	—	—		—	—	—
合計					1,992				△4,531

(注) 主として業種別委員会実務指針第25号に基づき、繰延ヘッジによっております。

[株式関連取引]

2020年9月30日現在及び2021年9月30日現在ともに、該当事項はありません。

[債券関連取引]

2020年9月30日現在及び2021年9月30日現在ともに、該当事項はありません。