デリバティブ取引情報

1. 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、時価及び評価損益並びに当該時価の算定方法は、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)

				2020年3	月31日		2021年3月31日			
区分	分 種類		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		
金融	金利先物	売建	-	-	-	-	-	-	-	-
金融商品取引所	並付近初	買建	-	-	-	-	-	-	-	-
騢	金利オプション	売建	-	-	-	-	-	-	-	-
所	並削オノンヨン	買建	-	-	-	-	-	-	-	-
	金利先渡契約	売建	-	-	-	-	-	-	-	-
		買建	-	-	-	-	-	-	-	-
		受取固定・支払変動	28,406	22,096	681	681	19,653	18,921	572	572
店	金利スワップ	受取変動・支払固定	28,406	22,096	△385	△385	19,653	18,921	△341	△341
		受取変動・支払変動	-	-	-	-	-	-	-	-
頭	金利オプション	売建	-	-	-	-	-	-	-	-
	並削オノンヨン	買建	-	-	-	-	-	-	-	-
	その他	売建	-	-	-	-	-	-	-	-
		買建	-	-	-	-	-	-	-	-
合言	t				295	295			230	230

⁽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。

店頭取引については、割引現在価値やオプション価格計算モデル等により算定しております。

●通貨関連取引

				2020年3	月31日		2021年3月31日			
区分	種 類		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		
金融	·孟华开	売建	-	-	-	-	-	-	-	-
商	通貨先物	買建	-	-	-	-	-	-	-	-
金融商品取引所	通貨オプション	売建	-	-	-	-	-	-	-	-
所		買建	-	-	-	-	-	-	-	-
	通貨スワップ		-	-	-	-	5,535	5,535	△177	△177
	為替予約	売建	70,738	1,596	△480	△480	71,394	749	△2,112	△2,112
店	河巴 1771	買建	74,075	1,159	435	435	51,475	586	1,933	1,933
	通貨オプション	売建	38,683	16,467	△647	311	49,506	13,827	△936	△48
頭	迪貝オノクヨノ	買建	38,683	16,467	647	△63	49,506	13,827	936	287
	その他	売建	-	-	-	-	-	-	-	-
		買建	-	-	-	-	-	-	-	-
合 計	t				△45	203			△355	△116

⁽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。

2. 時価の算定 割引現在価値等により算定しております。

(単位:百万円)

^{2.} 時価の算定

●株式関連取引 (単位: 百万円)

				2020年3	月31日		2021年3月31日			
区分			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		
金融	株式指数先物	売建	-	-	-	-	-	-	-	-
竇	休工行致无物	買建	-	-	-	-	-	-	-	-
取	株式指数 オプション	売建	1,008	-	△18	0	-	-	-	-
金融商品取引所		買建	-	-	-	-	-	-	-	-
	有価証券店頭 オプション	売建	-	-	-	-	-	-	-	-
		買建	-	-	-	-	-	-	-	-
店	有価証券店頭	株価指数変化率受取 ・短期変動金利支払	-	-	-	-	-	-	-	-
頭	指数等スワップ	短期変動金利受取· 株価指数変化率支払	-	-	-	-	-	-	-	-
	その他	売建	-	-	-	-	-	-	-	-
		買建	-	-	-	-	-	-	-	-
合言	合 計				△18	0			-	-

⁽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。

2. 時価の算定

取引所取引については、大阪取引所等における最終の価格によっております。

●債券関連取引 ●商品関連取引 ●クレジット・デリバティブ取引

該当ありません。 該当ありません。 該当ありません。

●その他
(単位: 百万円)

			2020年3月31日				2021年3月31日			
区分	1	重 類	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		
	地震	売建	7,930	-	△87	-	8,560	-	△95	-
店	デリバティブ	買建	7,930	-	△87	-	8,560	-	95	-
頭	天候	売建	-	-	-	-	200	-	△4	-
	デリバティブ	買建	-	-	-	-	200	-	4	-
合言	t				-	-			-	-

⁽注) 時価については、契約期間、その他当該取引に係る契約を構成する要素を勘案し、当該帳簿価額を記載しております。

2. 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並びに当該時価の算定方法は、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)

	種類		2.1.2.1	202	20年3月3	1⊟	2021年3月31日		
ヘッジ会計の 方法			主なヘッジ 対象	契約額等		時価	契約額等		時価
,,, <u>,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,</u>			7387		うち1年超			うち1年超	
	金利	受取固定・支払変動		-	-	-	-	-	-
E DIA MITE	スワップ	受取変動・支払固定		144,049	114,049	△32,076	113,312	93,312	△11,422
原則的処理 方法	金利先物金利オプション		券(債券)等の有利息 の金融資産	-	-	-	-	-	-
ZILI				-	-	-	-	-	-
	その他			-	-	-	-	-	-
金利スワップの	金利	受取固定・支払変動		-	-	-	-	-	-
特例処理	スワップ	受取変動・支払固定		-	-	-	-	-	-
	合 計					△32,076			△11,422

⁽注) 1. ヘッジ対象とヘッジ手段を紐付けする方法のほか、業種別委員会実務指針第24号に基づき、繰延ヘッジ (キャッシュ・フローを固定するヘッジ) によっております。

^{2.} 時価の算定

取引所取引については、東京金融取引所等における最終の価格によっております。店頭取引については、割引現在価値やオプション価格計算モデル等により算定しております。

●通貨関連取引 (単位:百万円)

^ >%△≡L		→+> A > "	202	20年3月31	日	2021年3月31日		
ヘッジ会計 の方法	種類	主なヘッジ 対象	契約額等		等 時価		契約額等	
		7.197		うち1年超			うち1年超	
E DIAL M TE	通貨スワップ		31,905	10,139	△49	31,955	15,348	△1,471
原則的処理 方法	為替予約	外貨建の有価証券等	-	-	-	-	-	-
	その他		-	-	-	-	-	-
為替予約等の	通貨スワップ		-	-	-	-	-	-
振当処理	為替予約		-	-	-	-	-	-
	合 計				△49			△1,471

⁽注) 1. 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。

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 ●債券関連取引

該当ありません。 該当ありません。

株式・資本の状況

●資本金の推移

(単位:百万円)

	2016年4月1日~ 2017年3月31日	2017年4月1日~ 2018年3月31日	2018年4月1日~ 2019年3月31日	2019年4月1日~ 2020年3月31日	2020年4月1日~ 2021年3月31日
資本金増減	-	-	-	-	-
資本金残高	42,103	42,103	42,103	42,103	42,103

●株式の所有者別状況

(2021年3月31日現在)

		株式の状況(1単元の株式数100株)								
区分	政府及び	◆□₩₩₽₽	金融商品	その他の	外国法人等		個人	計	- 単元未満 株式の状況	
	地方公共団体	金融機関	取引業者	法人	個人以外	個人	その他	ā1	(株)	
株主数(人)	2	55	27	351	462	1	6,028	6,926	-	
所有株式数(単元)	1,500	331,714	7,734	122,194	212,915	4	80,517	756,578	182,888	
所有株式数の割合(%)	0.20	43.85	1.02	16.15	28.14	0.00	10.64	100.00	-	

⁽注) 自己株式234,329株は「個人その他」に2,343単元、「単元未満株式の状況」に29株含まれております。

●大株主の状況

(2021年3月31日現在)

氏名又は名称	住所	所有株式数 (千株)	発行済株式(自己株式を 除く。)の総数に対する 所有株式数の割合(%)
日本マスタートラスト 信託銀行株式会社 (信託口)	東京都港区浜松町2丁目11番3号	4,945	6.54
日本生命保険相互会社	東京都千代田区丸の内1丁目6番6号	3,033	4.01
株式会社日本カストディ銀行(信託口)	東京都中央区晴海1丁目8番12号	2,566	3.39
東京海上日動火災保険株式会社	東京都千代田区丸の内1丁目2番1号	2,537	3.35
明治安田生命保険相互会社	東京都千代田区丸の内2丁目1番1号	2,500	3.30
THE BANK OF NEW YORK MELLON 140051 (常任代理人 株式会社みずほ銀行決済営業部)	240 GREENWICH STREET,NEW YORK,NY 10286,U.S.A. (東京都港区港南2丁目15番1号)	1,996	2.64
京セラ株式会社	京都市伏見区竹田鳥羽殿町6番地	1,596	2.11
NORTHERN TRUST CO. (AVFC) RE SILCHESTER INTERNATIONAL INVESTORS INTERNATIONAL VALUE EQUITY TRUST (常任代理人 香港上海銀行東京支店カストディ業務部)	50 BANK STREET CANARY WHARF LONDON E14 5NT, UK (東京都中央区日本橋3丁目11番1号)	1,588	2.10
日本マスタートラスト信託銀行株式会社 (退職給付信託口・オムロン株式会社口)	東京都港区浜松町2丁目11番3号	1,528	2.02
住友生命保険相互会社	東京都中央区築地7丁目18番24号	1,318	1.74
함		23,610	31.22

⁽注) 2020年7月14日付で公衆の縦覧に供されている大量保有報告書において、シルチェスター・インターナショナル・インベスターズ・エルエルピーが2020年7月10日現在で以下の株式を所有している旨が記載されているものの、当行として2021年3月31日現在における実質所有株式数の確認ができませんので、上記大株主の状況には含めており ません。なお、その大量保有報告書の内容は以下のとおりであります。

氏名又は名称	住所	保有株券等の数 (千株)	株券等保有割合 (%)
シルチェスター・インターナショナル・ インベスターズ・エルエルピー	英国ロンドン ダブリュー1ジェイ 6ティーエル、ブルトン ストリート1、 タイム アンド ライフ ビル5階	3,814	5.03