

証券業務／時価情報

Kirayaka Bank

公共債引受額

(単位：百万円)

	平成23年9月期	平成24年9月期
国債	—	—
地方債・政府保証債	500	650
合計	500	650

公共債ディーリング実績

1.商品有価証券売買高

(単位：百万円)

	平成23年9月期	平成24年9月期
商品国債	455	565
商品地方債	1	2
商品政府保証債	—	—
合計	456	567

公共債及び証券投資信託窓販実績

(単位：百万円)

	平成23年9月期	平成24年9月期
国債	190	185
地方債・政府保証債	—	—
合計	190	185
投資信託	2,363	1,066

2.商品有価証券平均残高

(単位：百万円)

	平成23年9月期	平成24年9月期
商品国債	4	0
商品地方債	219	227
商品政府保証債	—	—
その他の商品有価証券	—	—
合計	223	228

有価証券関係

1.満期保有目的の債券

(単位：百万円)

	種類	平成23年9月30日			平成24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	5,455	5,600	144	2,971	3,071	99
	その他	—	—	—	—	—	—
	小計	5,455	5,600	144	2,971	3,071	99
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	—	—	—	—	—	—
	その他	1,000	904	△ 95	1,000	930	△ 69
	小計	1,000	904	△ 95	1,000	930	△ 69
合計	6,455	6,504	49	3,971	4,001	30	

2.子会社・子法人等株式及び関連法人等株式

(単位：百万円)

	平成23年9月30日			平成24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
子会社・子法人等株式	—	—	—	—	—	—
関連法人等株式	—	—	—	—	—	—
合計	—	—	—	—	—	—

(注) 時価を把握することが極めて困難と認められる子会社・子法人等株式及び関連法人等株式

(単位：百万円)

	平成23年9月30日		平成24年9月30日	
	中間貸借対照表計上額	時価	中間貸借対照表計上額	時価
子会社・子法人等株式	1,013	—	5,865	—
関連法人等株式	17	—	17	—
合計	1,030	—	5,883	—

これらについては、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、「子会社・子法人等株式及び関連法人等株式」には含めておりません。

3.その他の有価証券

(単位：百万円)

	種類	平成23年9月30日			平成24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	875	609	265	1,183	794	388	
	債券	192,494	190,063	2,430	232,916	230,229	2,687	
		国債	120,786	119,021	1,764	89,883	89,207	676
		地方債	14,401	14,269	132	29,489	28,966	523
	社債	57,306	56,772	533	113,543	112,055	1,487	
	その他	22,504	22,103	401	32,555	32,152	403	
小計	215,874	212,777	3,097	266,655	263,175	3,479		
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	株式	3,773	4,870	△ 1,097	2,837	3,845	△ 1,007	
	債券	27,970	28,149	△ 179	16,082	16,143	△ 61	
		国債	1,983	1,993	△ 10	1,060	1,060	△ 0
		地方債	1,857	1,860	△ 3	1,355	1,357	△ 2
	社債	24,129	24,295	△ 165	13,666	13,725	△ 58	
	その他	40,167	43,952	△ 3,784	19,257	22,601	△ 3,343	
小計	71,911	76,972	△ 5,061	38,177	42,590	△ 4,412		
合計	287,786	289,750	△ 1,963	304,832	305,766	△ 933		

時価情報／デリバティブ取引情報

Kirayaka Bank

4.減損処理を行った有価証券

売買目的有価証券以外の有価証券（時価を把握することが極めて困難なものを除く）のうち、当該有価証券の時価が取得原価に比べて著しく下落しており、時価が取得原価まで回復する見込みがあると認められないものについては、当該時価をもって中間貸借対照表計上額とするとともに、評価差額を当中間会計期間の損失として処理（以下「減損処理」という。）しております。

前中間会計期間における減損処理額は、390百万円（うち株式390百万円）、当中間会計期間における減損処理額は、267百万円（うち株式210百万円）であります。

また、時価が「著しく下落した」と判断するための基準は、個々の銘柄について中間会計期間末日における時価が取得原価に比べて50%以上下落している場合はすべて実施しており、30%以上50%未満の下落率の場合は、発行会社の業績や過去一定期間の時価の推移等を考慮し、回復可能性が認められないと判断されるものについて実施しております。

金銭の信託関係

1. 満期保有目的の金銭の信託

[平成23年9月期・平成24年9月期] 該当ございません。

2. その他の金銭の信託（運用目的及び満期保有目的以外）

[平成23年9月期・平成24年9月期] 該当ございません。

その他有価証券評価差額金

中間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23年9月30日	平成24年9月30日
評価差額	△ 1,963	△ 933
その他有価証券	△ 1,963	△ 933
(△)繰延税金負債	—	—
その他有価証券評価差額金	△ 1,963	△ 933

デリバティブ取引の時価等に関する事項

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。

(1) 金利関連取引 [平成23年9月期・平成24年9月期] 該当ございません。

(2) 通貨関連取引

(単位：百万円)

区分	種類	平成23年9月30日				平成24年9月30日			
		契約額等	契約額等のうち 1年超のもの	時 価	評価損益	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	為替予約								
	売建	6	—	0	0	—	—	—	—
	買建	6	—	△ 0	△ 0	—	—	—	—
合 計		—	—	△ 0	△ 0	—	—	—	—

(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。

(3) 株式関連取引 [平成23年9月期・平成24年9月期] 該当ございません。

(4) 債券関連取引 [平成23年9月期・平成24年9月期] 該当ございません。

(5) 商品関連取引 [平成23年9月期・平成24年9月期] 該当ございません。

(6) クレジットデリバティブ取引 [平成23年9月期・平成24年9月期] 該当ございません。

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。

(1) 金利関連取引 [平成23年9月期・平成24年9月期] 該当ございません。

(2) 通貨関連取引 [平成23年9月期・平成24年9月期] 該当ございません。

(3) 株式関連取引 [平成23年9月期・平成24年9月期] 該当ございません。

(4) 債券関連取引 [平成23年9月期・平成24年9月期] 該当ございません。