

証券業務／時価情報

Kirayaka Bank

公共債引受額

(単位：百万円)

| | 2018年3月期 | 2019年3月期 |
|-----------|----------|----------|
| 国債 | — | — |
| 地方債・政府保証債 | 700 | 400 |
| 合計 | 700 | 400 |

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)

| | 2018年3月期 | 2019年3月期 |
|---------|----------|----------|
| 商品国債 | 56 | 32 |
| 商品地方債 | 0 | — |
| 商品政府保証債 | — | — |
| 合計 | 56 | 32 |

公共債及び証券投資信託窓販実績

(単位：百万円)

| | 2018年3月期 | 2019年3月期 |
|-----------|----------|----------|
| 国債 | — | 97 |
| 地方債・政府保証債 | — | — |
| 合計 | — | 97 |
| 投資信託 | 5,704 | 3,297 |

2. 商品有価証券平均残高

(単位：百万円)

| | 2018年3月期 | 2019年3月期 |
|------------|----------|----------|
| 商品国債 | 0 | 0 |
| 商品地方債 | 8 | 2 |
| 商品政府保証債 | — | — |
| その他の商品有価証券 | — | — |
| 合計 | 8 | 2 |

有価証券関係

※貸借対照表の「有価証券」のほか、「商品有価証券」を含めて記載しております。

1. 売買目的有価証券

(単位：百万円)

| | 2018年3月31日 | 2019年3月31日 |
|----------|-----------------|-----------------|
| | 当年度の損益に含まれた評価差額 | 当年度の損益に含まれた評価差額 |
| 売買目的有価証券 | 0 | 0 |

2. 満期保有目的の債券

(単位：百万円)

| | 種類 | 2018年3月31日 | | | 2019年3月31日 | | |
|--------------------|------|------------|-------|-----|------------|----|----|
| | | 貸借対照表計上額 | 時価 | 差額 | 貸借対照表計上額 | 時価 | 差額 |
| 時価が貸借対照表計上額を超えるもの | 国債 | — | — | — | — | — | — |
| | 地方債 | — | — | — | — | — | — |
| | 短期社債 | — | — | — | — | — | — |
| | 社債 | — | — | — | — | — | — |
| | その他 | 7,000 | 7,340 | 340 | — | — | — |
| | 小計 | 7,000 | 7,340 | 340 | — | — | — |
| 時価が貸借対照表計上額を超えないもの | 国債 | — | — | — | — | — | — |
| | 地方債 | — | — | — | — | — | — |
| | 短期社債 | — | — | — | — | — | — |
| | 社債 | — | — | — | — | — | — |
| | その他 | — | — | — | — | — | — |
| | 小計 | — | — | — | — | — | — |
| 合計 | | 7,000 | 7,340 | 340 | — | — | — |

3. 子会社株式及び関連会社株式

(単位：百万円)

| | 2018年3月31日 | | | 2019年3月31日 | | |
|--------|------------|----|----|------------|----|----|
| | 貸借対照表計上額 | 時価 | 差額 | 貸借対照表計上額 | 時価 | 差額 |
| 子会社株式 | — | — | — | — | — | — |
| 関連会社株式 | — | — | — | — | — | — |
| 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株式及び関連会社株式

(単位：百万円)

| | 2018年3月31日 | 2019年3月31日 |
|--------|------------|------------|
| | 貸借対照表計上額 | 貸借対照表計上額 |
| 子会社株式 | 4,015 | 4,015 |
| 関連会社株式 | 0 | 0 |
| 合計 | 4,015 | 4,015 |

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、「子会社株式及び関連会社株式」には含めておりません。

時価情報

Kirayaka Bank

4. その他有価証券

(単位：百万円)

| | 種類 | 2018年3月31日 | | | 2019年3月31日 | | |
|--------------------------|---------|------------|---------|---------|------------|---------|---------|
| | | 貸借対照表計上額 | 取得原価 | 差額 | 貸借対照表計上額 | 取得原価 | 差額 |
| 貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの | 株式 | 2,727 | 1,620 | 1,107 | 1,254 | 824 | 430 |
| | 債券 | 119,472 | 118,059 | 1,413 | 119,250 | 117,994 | 1,256 |
| | 国債 | 66,030 | 65,366 | 664 | 58,899 | 58,401 | 497 |
| | 地方債 | 6,997 | 6,932 | 65 | 10,657 | 10,564 | 93 |
| | 短期社債 | — | — | — | — | — | — |
| | 社債 | 46,443 | 45,759 | 683 | 49,693 | 49,028 | 664 |
| | その他 | 25,266 | 24,778 | 487 | 26,747 | 26,285 | 462 |
| 小計 | 147,466 | 144,457 | 3,008 | 147,252 | 145,104 | 2,148 | |
| 貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの | 株式 | 3,195 | 3,692 | △ 497 | 2,106 | 2,714 | △ 608 |
| | 債券 | 23,980 | 24,547 | △ 567 | 3,682 | 3,706 | △ 24 |
| | 国債 | 16,994 | 17,533 | △ 539 | — | — | — |
| | 地方債 | — | — | — | — | — | — |
| | 短期社債 | — | — | — | — | — | — |
| | 社債 | 6,986 | 7,014 | △ 27 | 3,682 | 3,706 | △ 24 |
| | その他 | 75,016 | 78,892 | △ 3,876 | 65,416 | 68,194 | △ 2,778 |
| 小計 | 102,192 | 107,133 | △ 4,940 | 71,204 | 74,616 | △ 3,411 | |
| 合計 | 249,658 | 251,590 | △ 1,932 | 218,457 | 219,720 | △ 1,263 | |

(注) 時価を把握することが極めて困難と認められるその他有価証券

(単位：百万円)

| | 2018年3月31日 | | 2019年3月31日 | |
|-----|------------|--|------------|--|
| | 貸借対照表計上額 | | 貸借対照表計上額 | |
| 株式 | 1,426 | | 1,616 | |
| その他 | — | | 332 | |
| 合計 | 1,426 | | 1,948 | |

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、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

5. 期中に売却した満期保有目的の債券

(単位：百万円)

| | 2018年3月期 | | | 2019年3月期 | | |
|-----|----------|-----|------|----------|-------|------|
| | 売却原価 | 売却額 | 売却損益 | 売却原価 | 売却額 | 売却損益 |
| 国債 | — | — | — | — | — | — |
| 地方債 | — | — | — | — | — | — |
| 社債 | — | — | — | — | — | — |
| その他 | — | — | — | 7,000 | 7,267 | 267 |
| 合計 | — | — | — | 7,000 | 7,267 | 267 |

(売却の理由) 2019年3月期

当事業年度において、将来に渡る金利リスクの拡大を抑制するため、満期保有目的の債券を売却しております。

なお、当事業年度において、当行が保有する満期保有目的の債券を全額売却しているため、これに伴う有価証券の保有目的の変更はありません。

6. 期中に売却したその他有価証券

(単位：百万円)

| | 2018年3月期 | | | 2019年3月期 | | |
|------|----------|---------|---------|----------|---------|---------|
| | 売却額 | 売却益の合計額 | 売却損の合計額 | 売却額 | 売却益の合計額 | 売却損の合計額 |
| 株式 | 4,616 | 643 | 43 | 6,101 | 870 | 818 |
| 債券 | 233 | 3 | — | 6,198 | 129 | — |
| 国債 | — | — | — | — | — | — |
| 地方債 | — | — | — | 2,963 | 25 | — |
| 短期社債 | — | — | — | — | — | — |
| 社債 | 233 | 3 | — | 3,235 | 103 | — |
| その他 | — | — | — | 3,038 | 38 | — |
| 合計 | 4,849 | 646 | 43 | 15,337 | 1,037 | 818 |

7.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、当該時価をもって貸借対照表計上額とするともに、評価差額を当事業年度の損失として処理（以下、「減損処理」という。）しております。

前事業年度における減損処理額は、0百万円（うち債券-百万円）であります。

当事業年度における減損処理額は、211百万円（うち、株式211百万円、債券0百万円）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、主として資産の自己査定基準において、有価証券の発行会社の区分ごとに次のとおり定めております。

| | |
|-----------------|--|
| 破綻先・実質破綻先・破綻懸念先 | 時価が取得原価に比べ下落 |
| 要注意先 | 時価が取得原価に比べ30%以上下落 |
| 正常先 | 時価が取得原価に比べ50%以上下落、または、時価が取得原価に比べ30%以上50%未満下落したもので市場価格が一定水準以下で推移等 |

破綻先：破産、特別清算、会社更生、民事再生、手形交換所における取引停止処分等、法的・形式的に経営破綻の事実が発生している発行会社

実質破綻先：実質的に経営破綻に陥っている発行会社

破綻懸念先：今後、経営破綻に陥る可能性が大きいと認められる発行会社

要注意先：今後の管理に注意を要する発行会社

正常先：上記破綻先、実質破綻先、破綻懸念先及び要注意先以外の発行会社

金銭の信託関係

1. 運用目的の金銭の信託

[2018年3月期・2019年3月期] 該当ございません。

2. 満期保有目的の金銭の信託

[2018年3月期・2019年3月期] 該当ございません。

3. その他の金銭の信託（運用目的及び満期保有目的以外）

[2018年3月期・2019年3月期] 該当ございません。

時価情報／デリバティブ取引情報

Kirayaka Bank

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)

| | 2018年3月31日 | 2019年3月31日 |
|------------------------|------------|------------|
| 評価差額 | △ 1,932 | △ 1,263 |
| その他有価証券 | △ 1,932 | △ 1,263 |
| (+)繰延税金資産(又は(△)繰延税金負債) | 612 | 372 |
| その他有価証券評価差額金 | △ 1,320 | △ 890 |

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 [2018年3月期・2019年3月期] 該当ございません。
- (2) 通貨関連取引 [2018年3月期・2019年3月期] 該当ございません。
- (3) 株式関連取引 [2018年3月期・2019年3月期] 該当ございません。
- (4) 債券関連取引 [2018年3月期・2019年3月期] 該当ございません。
- (5) 商品関連取引 [2018年3月期・2019年3月期] 該当ございません。
- (6) クレジットデリバティブ取引 [2018年3月期・2019年3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 [2018年3月期・2019年3月期] 該当ございません。
- (2) 通貨関連取引 [2018年3月期・2019年3月期] 該当ございません。
- (3) 株式関連取引 [2018年3月期・2019年3月期] 該当ございません。
- (4) 債券関連取引 [2018年3月期・2019年3月期] 該当ございません。