



## 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。

#### (1) 金利関連取引

(単位：百万円)

| 区分      | 種類        | 第122期中（2024年9月末現在） |         |       |       | 第123期中（2025年9月末現在） |         |         |         |
|---------|-----------|--------------------|---------|-------|-------|--------------------|---------|---------|---------|
|         |           | 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      |                    |         |       |       |                    |         |         |         |
|         | 売 建       | —                  | —       | —     | —     | —                  | —       | —       | —       |
|         | 買 建       | —                  | —       | —     | —     | —                  | —       | —       | —       |
|         | 金利オプション   |                    |         |       |       |                    |         |         |         |
|         | 売 建       | —                  | —       | —     | —     | —                  | —       | —       | —       |
|         | 買 建       | —                  | —       | —     | —     | 365                | —       | 0       | △ 13    |
| 店頭      | 金利先渡契約    |                    |         |       |       |                    |         |         |         |
|         | 売 建       | —                  | —       | —     | —     | —                  | —       | —       | —       |
|         | 買 建       | —                  | —       | —     | —     | —                  | —       | —       | —       |
|         | 金利スワップ    |                    |         |       |       |                    |         |         |         |
|         | 受取固定・支払変動 | 356,244            | 193,852 | △ 603 | △ 603 | 273,411            | 168,094 | △ 4,782 | △ 4,782 |
|         | 受取変動・支払固定 | 254,002            | 251,332 | 2,298 | 2,298 | 201,853            | 167,998 | 6,667   | 6,667   |
|         | 受取変動・支払変動 | —                  | —       | —     | —     | —                  | —       | —       | —       |
|         | 金利オプション   |                    |         |       |       |                    |         |         |         |
|         | 売 建       | —                  | —       | —     | —     | —                  | —       | —       | —       |
|         | 買 建       | —                  | —       | —     | —     | —                  | —       | —       | —       |
|         | その他       |                    |         |       |       |                    |         |         |         |
|         | 売 建       | —                  | —       | —     | —     | —                  | —       | —       | —       |
|         | 買 建       | —                  | —       | —     | —     | —                  | —       | —       | —       |
|         | 合 計       | —                  | —       | 1,695 | 1,695 | —                  | —       | 1,885   | 1,870   |

(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。

#### (2) 通貨関連取引

(単位：百万円)

| 区分      | 種類      | 第122期中（2024年9月末現在） |         |         |         | 第123期中（2025年9月末現在） |         |          |          |
|---------|---------|--------------------|---------|---------|---------|--------------------|---------|----------|----------|
|         |         | 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    |                    |         |         |         |                    |         |          |          |
|         | 売 建     | —                  | —       | —       | —       | —                  | —       | —        | —        |
|         | 買 建     | —                  | —       | —       | —       | —                  | —       | —        | —        |
|         | 通貨オプション |                    |         |         |         |                    |         |          |          |
|         | 売 建     | —                  | —       | —       | —       | —                  | —       | —        | —        |
|         | 買 建     | —                  | —       | —       | —       | —                  | —       | —        | —        |
| 店頭      | 通貨スワップ  | 477,203            | 468,639 | 192     | 192     | 488,832            | 479,899 | 171      | 171      |
|         | 為替予約    |                    |         |         |         |                    |         |          |          |
|         | 売 建     | 418,303            | 136,614 | △ 9,345 | △ 9,345 | 563,265            | 121,772 | △ 23,447 | △ 23,447 |
|         | 買 建     | 340,997            | 240,628 | 12,333  | 12,333  | 352,073            | 116,295 | 25,514   | 25,514   |
|         | 通貨オプション |                    |         |         |         |                    |         |          |          |
|         | 売 建     | 243,409            | 121,306 | △ 8,398 | △ 2,214 | 266,124            | 134,323 | △ 6,982  | △ 695    |
|         | 買 建     | 164,908            | 121,306 | 8,143   | 2,992   | 181,681            | 134,323 | 6,757    | 1,638    |
|         | その他     |                    |         |         |         |                    |         |          |          |
|         | 売 建     | —                  | —       | —       | —       | —                  | —       | —        | —        |
|         | 買 建     | —                  | —       | —       | —       | —                  | —       | —        | —        |
|         | 合 計     | —                  | —       | 2,926   | 3,959   | —                  | —       | 2,013    | 3,181    |

(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。

#### (3) 株式関連取引

該当事項はありません。

(4) 債券関連取引

(単位：百万円)

| 区分      | 種類        | 第122期中（2024年9月末現在） |       |    |      | 第123期中（2025年9月末現在） |       |      |      |
|---------|-----------|--------------------|-------|----|------|--------------------|-------|------|------|
|         |           | 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 | 債券先物      |                    |       |    |      |                    |       |      |      |
|         | 売 建       | —                  | —     | —  | —    | 4,462              | —     | △ 46 | △ 46 |
|         | 買 建       | —                  | —     | —  | —    | 4,459              | —     | 26   | 26   |
|         | 債券先物オプション |                    |       |    |      |                    |       |      |      |
|         | 売 建       | —                  | —     | —  | —    | —                  | —     | —    | —    |
| 店頭      | 買 建       | —                  | —     | —  | —    | —                  | —     | —    | —    |
|         | 債券店頭オプション |                    |       |    |      |                    |       |      |      |
|         | 売 建       | —                  | —     | —  | —    | —                  | —     | —    | —    |
|         | 買 建       | —                  | —     | —  | —    | —                  | —     | —    | —    |
|         | その他       |                    |       |    |      |                    |       |      |      |
|         | 売 建       | —                  | —     | —  | —    | —                  | —     | —    | —    |
|         | 買 建       | —                  | —     | —  | —    | —                  | —     | —    | —    |
| 合 計     |           | —                  | —     | —  | —    | —                  | —     | △ 20 | △ 20 |

(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。

(5) 商品関連取引  
該当事項はありません。

(6) クレジット・デリバティブ取引  
該当事項はありません。

## 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

(単位：百万円)

| ヘッジ会計の方法    | 種 類       | 第122期中（2024年9月末現在） |         |         |       | 第123期中（2025年9月末現在） |         |         |        |
|-------------|-----------|--------------------|---------|---------|-------|--------------------|---------|---------|--------|
|             |           | 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<br>処理方法 | 金利スワップ    | 貸 出 金              |         |         |       | 貸 出 金              |         |         |        |
|             | 受取固定・支払変動 |                    | 28,546  | 28,546  | 448   |                    | —       | —       | —      |
|             | 受取変動・支払固定 |                    | 543,640 | 538,100 | 6,713 |                    | 812,608 | 741,608 | 19,281 |
|             | 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    |                    |         |         |       |                    |         |         |        |
|             | 受取固定・支払変動 | —                  | —       | —       | —     | —                  | —       | —       | —      |
|             | 受取変動・支払固定 | —                  | —       | —       | —     | —                  | —       | —       | —      |
| 合 計         |           | —                  | —       | —       | 7,161 | —                  | —       | —       | 19,281 |

(注) 主として「銀行業における金融商品会計基準適用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委員会実務指針第24号 2022年3月17日)に基づき、繰延ヘッジによっております。

### (2) 通貨関連取引

(単位：百万円)

| ヘッジ会計の方法    | 種 類      | 第122期中（2024年9月末現在） |         |         |          | 第123期中（2025年9月末現在） |         |         |          |
|-------------|----------|--------------------|---------|---------|----------|--------------------|---------|---------|----------|
|             |          | 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<br>処理方法 | 通貨スワップ   | 外貨建金銭債権等           | 550,650 | 333,839 | △ 21,641 | 外貨建金銭債権等           | 753,495 | 482,616 | △ 27,726 |
|             | 資金関連スワップ |                    | —       | —       | —        |                    | —       | —       | —        |
| 為替予約等の振当処理  | 通貨スワップ   | —                  | —       | —       | —        | —                  | —       | —       | —        |
|             | 為替予約     | —                  | —       | —       | —        | —                  | —       | —       | —        |
| 合 計         |          | —                  | —       | —       | △ 21,641 | —                  | —       | —       | △ 27,726 |

(注) 主として「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委員会実務指針第25号 2020年10月8日)に基づき、繰延ヘッジによっております。

(3) 株式関連取引、(4) 債券関連取引については、該当事項はありません。

## 電子決済手段

該当事項はありません。

## 暗号資産

該当事項はありません。