

● **デリバティブ取引関係**

第143期(平成18年4月1日から平成19年3月31日)

1. 取引の状況に関する事項

- (1) 取引の内容
 当行グループが利用しているデリバティブ取引は当行のみが、金利関連では金利スワップ取引、通貨関連では通貨スワップ取引及び為替予約取引(資金関連のスワップ取引を含む。以下同じ)、有価証券関連では債券店頭オプション取引を取扱っております。
- (2) 取引に対する取組方針及び利用目的
 デリバティブ取引について、貸出金、為替予約取引等に係る市場リスクの回避を主目的としてヘッジ取引を中心に取組んでおります。金利スワップ取引は中長期固定貸出金の金利変動リスクを回避し、安定的な収益を確保するための有効なリスクヘッジ手段として取組みを行っております。また、為替予約取引は外貨建金銭債権債務の残高の範囲内で、外貨建債権債務に係る将来の為替レートの変動リスクを回避する目的で取組を行っております。
- (3) 取引に係るリスクの内容
 デリバティブ取引は、金利・為替・価格変動などの市場の変化により損失が発生する市場リスク及び信用リスク等を有しております。為替予約取引における対顧客取引は実需に基づく取引に限定し、与信取引として厳正な審査の上、信用確実な先に対してのみ取引を行っております。金利スワップ取引・為替予約取引とも対銀行取引については信用度の高い銀行に限定し取引を行っております。なお、平成19年3月31日現在でデリバティブ取引における信用リスク相当額(取引の相手先に債務不履行が生じた場合に当行の蒙る損失を定量化した額)は、金利スワップ取引で370百万円(カレント・エクスポート方式にて算出)、為替予約取引で781百万円(カレント・エクスポート方式にて算出)となっております。なお、平成19年3月31日現在の債券店頭オプション契約額はありませぬ。
- (4) 取引に係るリスク管理体制
 デリバティブ取引につきましては、その取組限度額を業務執行会議で決定し、運用状況についても毎月報告を行っております。これを受け、各部署は取引限度額、取引手続き等を定めた行内規定に基づき取引を行っております。また、市場金融部の金利スワップ取引・為替予約取引・債券店頭オプション取引の各部署で日々ポジション管理を行い毎月信用リスク相当額を算出し業務執行会議に報告しております。

(注) 1. 上記取引については時価評価を行い、評価損益を連結損益計算書に計上しております。なお、ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引は、上記記載から除いております。
 2. 時価の算定
 取引所取引につきましては、東京金融先物取引所等における最終の価格によっております。店頭取引につきましては、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。

(2) 通貨関連取引 (単位:百万円)

区分	種類	平成19年3月期(平成19年3月31日現在)			
		契約額等	期間の満了引当額	時価	評価損益
店頭	通貨スワップ	14,435	14,435	14	14
	為替予約				
	売建 買建	235 252	- -	2 0	2 0
合計		-	-	17	17

(注) 1. 上記については時価評価を行い、評価損益を連結損益計算書に計上しております。なお、ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引及び外貨建金銭債権債務等に付されたもので当該外貨建金銭債権債務等が連結手続上消去されたものについては、上記記載から除いております。
 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. 従来、引直し対象としていた先物為替予約、通貨オプション等は、前連結会計年度からは上記に含めて記載しております。なお、「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監査委員会報告第25号)に基づきヘッジ会計を適用している通貨スワップ取引等については、上記記載から除いております。

(3) 株式関連取引(平成19年3月31日現在)
 該当ありません。

(4) 債券関連取引(平成19年3月31日現在)
 該当ありません。

(5) 商品関連取引(平成19年3月31日現在)
 該当ありません。

(6) クレジットデリバティブ取引(平成19年3月31日現在)
 該当ありません。

2. 取引の時価等に関する事項

(1) 金利関連取引(平成19年3月31日現在) (単位:百万円)

区分	種類	平成19年3月期(平成19年3月31日現在)			
		契約額等	期間の満了引当額	時価	評価損益
店頭	金利スワップ				
	受取変動・固定支払	2,246	1,400	△28	△28
合計		2,246	1,400	△28	△28

● **デリバティブ取引関係**

第142期(平成17年4月1日から平成18年3月31日)

1. 取引の状況に関する事項

- (1) 取引の内容
 当行グループが利用しているデリバティブ取引は当行のみが、金利関連では金利スワップ取引、通貨関連では通貨スワップ取引及び為替予約取引(資金関連のスワップ取引を含む。以下同じ)、有価証券関連では債券店頭オプション取引を取扱っております。
- (2) 取引に対する取組方針及び利用目的
 デリバティブ取引について、貸出金、為替予約取引等に係る市場リスクの回避を主目的としてヘッジ取引を中心に取組んでおります。金利スワップ取引は中長期固定貸出金の金利変動リスクを回避し、安定的な収益を確保するための有効なリスクヘッジ手段として取組みを行っております。また、為替予約取引は外貨建金銭債権債務の残高の範囲内で、外貨建債権債務に係る将来の為替レートの変動リスクを回避する目的で取組を行っております。
- (3) 取引に係るリスクの内容
 デリバティブ取引は、金利・為替・価格変動などの市場の変化により損失が発生する市場リスク及び信用リスク等を有しております。為替予約取引における対顧客取引は実需に基づく取引に限定し、与信取引として厳正な審査の上、信用確実な先に対してのみ取引を行っております。金利スワップ取引・為替予約取引とも対銀行取引については信用度の高い銀行に限定し取引を行っております。なお、平成18年3月31日現在でデリバティブ取引における信用リスク相当額(取引の相手先に債務不履行が生じた場合に当行の蒙る損失を定量化した額)は、金利スワップ取引で131百万円(カレント・エクスポート方式にて算出)、為替予約取引で233百万円(オリジナル・エクスポート方式にて算出)となっております。なお、平成18年3月31日現在の債券店頭オプション契約額はありませぬ。
- (4) 取引に係るリスク管理体制
 デリバティブ取引につきましては、その取組限度額を業務執行会議で決定し、運用状況についても毎月報告を行っております。これを受け、各部署は取引限度額、取引手続き等を定めた行内規定に基づき取引を行っております。また、市場金融部の金利スワップ取引・為替予約取引・債券店頭オプション取引の各部署で日々ポジション管理を行い毎月信用リスク相当額を算出し業務執行会議に報告しております。

(注) 1. 上記取引については時価評価を行い、評価損益を連結損益計算書に計上しております。なお、ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引は、上記記載から除いております。
 2. 時価の算定
 取引所取引につきましては、東京金融先物取引所等における最終の価格によっております。店頭取引につきましては、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。

(2) 通貨関連取引 (単位:百万円)

区分	種類	平成18年3月期(平成18年3月31日現在)			
		契約額等	期間の満了引当額	時価	評価損益
店頭	通貨スワップ	3,741	3,741	4	4
	為替予約				
	売建 買建	1,620 1,641	- -	△1 1	△1 1
合計		-	-	5	5

(注) 1. 上記については時価評価を行い、評価損益を連結損益計算書に計上しております。なお、ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引及び外貨建金銭債権債務等に付されたもので当該外貨建金銭債権債務等が連結手続上消去されたものについては、上記記載から除いております。
 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18年3月31日現在)
 該当ありません。

(4) 債券関連取引(平成18年3月31日現在)
 該当ありません。

(5) 商品関連取引(平成18年3月31日現在)
 該当ありません。

(6) クレジットデリバティブ取引(平成18年3月31日現在)
 該当ありません。

2. 取引の時価等に関する事項

(1) 金利関連取引(平成18年3月31日現在) (単位:百万円)

区分	種類	平成18年3月期(平成18年3月31日現在)			
		契約額等	期間の満了引当額	時価	評価損益
店頭	金利スワップ				
	受取変動・固定支払	3,342	2,582	△68	△68
合計		3,342	2,582	△68	△68

● **内国為替の状況**

(単位:千口、百万円)

		平成18年3月期		平成19年3月期	
		口数	金額	口数	金額
送金為替	各地へ向けた分	3,065	2,284,680	3,125	2,218,903
	各地より受けた分	3,034	2,320,851	3,120	2,261,750
代金取立	各地へ向けた分	45	64,830	40	57,998
	各地より受けた分	62	100,057	58	93,233

● **外貨建資産残高**

(単位:百万米ドル)

	平成18年3月期	平成19年3月期
外貨建資産残高	41	77

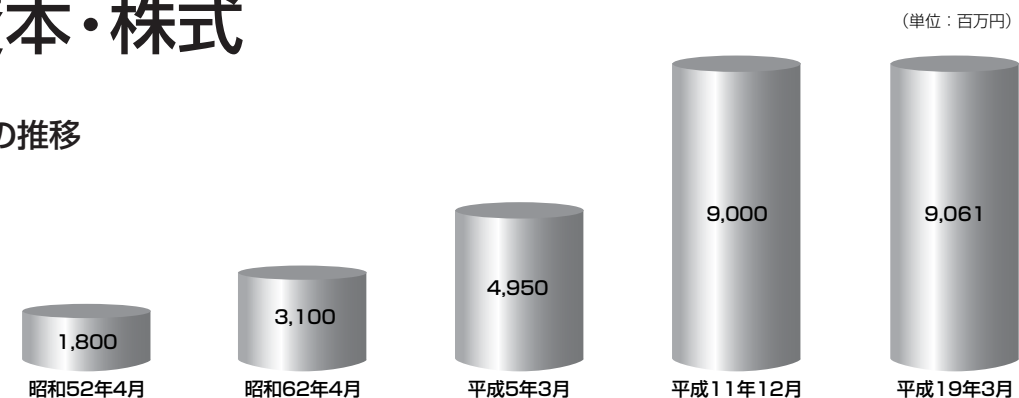
● **外国為替の状況**

(単位:百万米ドル)

	平成18年3月期	平成19年3月期
仕向為替	238	301
買入為替	87	59
被仕向為替	224	261
取立為替	17	12
合計	567	634

資本・株式

● **資本の推移**



● **所有者別状況**

(平成19年3月31日現在)

	株式の状況(1単元の株式数1,000株)							単元未満株式の状況(株)
	政府及び地方公共団体	金融機関	証券会社	その他の法人	外国法人等(個人)	個人その他	計	
株主数(人)	1人	48	21	750	47	3,233	4,100	-株
所有株式数(単元)	2単位	29,748	993	32,788	1,405	30,168	95,104	1,095,386
所有株式数の割合(%)	0.00%	31.28	1.04	34.48	1.48	31.72	100.0	-

(注) 1. 自己株式1,173,802株は個人その他に1,173単元、単元未満株式の状況に802株含まれております。
 2. 「その他の法人」の欄には証券保管振替機構名義の株式が22単元含まれております。

● **大株主一覧**

(平成19年3月31日現在)

氏名又は名称	住所	所有株式数	発行済株式総数に対する所有株式数の割合
株式会社三菱東京UFJ銀行	東京都千代田区丸の内2丁目7-1	4,630千株	4.81%
日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社	東京都中央区晴海1丁目8-11	4,340	4.51
明治生命保険相互会社 兼任代理人 資産管理サービス信託銀行株式会社	東京都中央区晴海1丁目8番12号 晴海アイランドトリトンスクエアオフィスタワー2棟	3,426	3.56
株式会社損害保険ジャパン	東京都新宿区西新宿1丁目26-1	3,122	3.24
第一生命保険相互会社 兼任代理人 資産管理サービス信託銀行株式会社	東京都中央区晴海1丁目8番12号 晴海アイランドトリトンスクエアオフィスタワー2棟	2,943	3.05
鳥取銀行従業員持株会	鳥取県鳥取市永楽温泉町171番地	2,412	2.50
三井生命株式会社 兼任代理人 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社	東京都中央区晴海1丁目8-11	1,681	1.74
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2-1	1,275	1.32
三井信託銀行株式会社 兼任代理人 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社	東京都港区浜松町2丁目11-3	1,093	1.13
三信株式会社	東京都新宿区西新宿1丁目6-1	1,039	1.08
計		25,961	26.98

(注) 1. 上記の信託銀行所有株式数のうち、信託業務に係る株式数は、次のとおりであります。
 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社 4,340千株
 三菱UFJ信託銀行株式会社 506千株
 2. 上記の第一生命保険相互会社所有株式には、特別勘定年金口が3千株含まれております。
 3. 上記のほか、自己株式が1,173株あります。