

# デリバティブ取引情報 (単体)

## 1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

### ■金利関連取引

(単位: 百万円)

			2015年3月末				2016年3月末			
			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			
金融商品	金利先物	売建	—	—	—	—	—	—	—	—
取引所		買建	—	—	—	—	19,756	—	3	3
店頭	金利スワップ	受取固定・支払変動	21,789,058	18,379,774	373,990	373,990	18,479,011	14,853,916	469,031	469,031
		受取変動・支払固定	21,362,719	17,894,213	△359,019	△359,019	18,034,990	14,453,561	△456,866	△456,866
		受取変動・支払変動	5,932,740	4,551,040	5,432	5,432	5,867,900	5,115,900	5,698	5,698
	キャップ	売建	38,935	31,394	△639	689	22,852	17,619	△396	425
		買建	—	—	—	—	—	—	—	—
	フロアー	売建	3,000	—	28	△0	—	—	—	—
		買建	56,892	51,347	1,023	926	37,825	32,192	795	729
	スワップション	売建	133,400	24,000	1,869	△218	26,000	16,000	754	△225
		買建	350,800	234,800	1,455	145	250,800	26,800	1,935	704
合計			/	/	21,624	21,946	/	/	20,240	19,500

(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

取引所取引につきましては、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。

### ■通貨関連取引

(単位: 百万円)

			2015年3月末				2016年3月末			
			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			
店頭	通貨スワップ		1,004,787	871,787	△16,521	△3,355	802,182	545,816	△14,037	△155
	為替予約	売建	685,031	72,876	△48,374	△48,374	539,376	48,251	△4,503	△4,503
		買建	926,986	167,046	126,312	126,312	598,443	90,300	31,611	31,611
	通貨オプション	売建	713,034	211,001	92,460	△54,720	253,332	82,510	26,580	△12,303
		買建	684,209	211,478	35,934	8,744	254,445	78,073	9,473	△2,896
合計			/	/	4,890	28,607	/	/	△4,036	11,751

(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。

### ■株式関連取引

(単位: 百万円)

			2015年3月末				2016年3月末			
			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			
金融商品	株式指数先物	売建	54,023	—	△552	△552	—	—	—	—
取引所		買建	—	—	—	—	—	—	—	—
	株式指数オプション	売建	—	—	—	—	—	—	—	—
		買建	3,825	—	68	7	—	—	—	—
合計			/	/	△484	△545	/	/	—	—

(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。

2. 時価の算定

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

(単位：百万円)

	2015年3月末						2016年3月末					
	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							
金融商品	債券先物	売建	268,902	—	△1,198	△1,198	1,212	—	2	2		
取引所		買建	—	—	—	—	—	—	—	—		
店頭	債券店頭オプション	売建	—	—	—	—	15,150	—	67	21		
		買建	—	—	—	—	—	—	—	—		
合計			/	/	△1,198	△1,198	/	/	69	23		

(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  
 取引所取引につきましては、大阪取引所等における最終の価格によっております。  
 店頭取引につきましては、オプション価格計算モデル等により算定しております。

## ■商品関連取引

2015年3月末、2016年3月末とも該当事項はありません。

## ■クレジット・デリバティブ取引

2015年3月末、2016年3月末とも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

## ■金利関連取引

(単位：百万円)

	主なヘッジ対象	2015年3月末			2016年3月末				
		契約額等		時価	契約額等		時価		
		うち1年超			うち1年超				
原則的処理方法	金利スワップ	受取固定・支払変動	貸出金、預金等の有利 利息の金融資産・負債	2,110,727	1,810,000	82,325	1,910,000	1,660,000	91,295
		受取変動・支払固定		606,495	596,261	△28,070	594,141	518,507	△20,187
金利スワップの特例処理	金利スワップ	受取変動・支払固定	貸出金	—	—	—	—	—	—
合計				/	/	54,255	/	/	71,107

(注) 1. 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監査委員会報告第24号 2002年2月13日)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。

## ■通貨関連取引

(単位：百万円)

	主なヘッジ対象	2015年3月末			2016年3月末			
		契約額等		時価	契約額等		時価	
		うち1年超			うち1年超			
原則的処理方法	通貨スワップ	外貨建の貸出金、預金等の 金融資産・負債	569,002	144,494	20,725	745,601	636	10,339

(注) 1. 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監査委員会報告第25号 2002年7月29日)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

2015年3月末、2016年3月末とも該当事項はありません。

## ■債券関連取引

2015年3月末、2016年3月末とも該当事項はありません。