

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

■金利関連取引

(単位:百万円)

			2014年9月末				2015年9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	—	—	—	—	33,693	—	△10	△10
取引所		買建	24,153	24,153	—	—	30,357	30,357	11	11
店頭	金利スワップ	受取固定・支払変動	23,951,020	20,597,415	439,502	439,502	19,588,952	16,292,738	352,905	352,905
		受取変動・支払固定	23,254,988	20,100,220	△425,040	△425,040	19,210,874	15,693,025	△338,796	△338,796
		受取変動・支払変動	5,352,610	4,650,610	5,990	5,990	5,978,290	4,775,190	4,640	4,640
	キャップ	売建	52,920	43,845	△824	877	28,888	24,094	△501	545
		買建	—	—	—	—	—	—	—	—
	フロアー	売建	3,000	—	55	△19	—	—	—	—
		買建	68,489	63,148	1,344	1,218	46,965	40,412	876	797
	スワップション	売建	727,400	33,000	2,275	936	89,000	24,000	1,373	△210
		買建	869,800	221,800	6,158	660	261,800	32,800	1,362	379
合計			/	/	26,450	24,126	/	/	20,116	20,262

(注) 1. 上記取引については時価評価を行い、評価損益を中間連結損益計算書に計上しております。
 2. 時価の算定
 取引所取引については、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。
 店頭取引については、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)

			2014年9月末				2015年9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		1,280,865	1,062,186	△14,337	△1,809	867,862	713,474	△15,647	△2,171
	為替予約	売建	734,307	105,795	△46,742	△46,742	705,347	54,871	△32,225	△32,225
		買建	1,130,925	232,736	112,860	112,860	863,658	121,630	79,179	79,179
	通貨オプション	売建	1,122,390	451,367	102,799	△43,962	538,272	176,654	70,215	△42,685
		買建	1,085,165	418,083	37,170	△2,279	531,626	155,793	27,546	6,247
合計			/	/	△13,848	18,066	/	/	△11,363	8,343

(注) 1. 上記取引については時価評価を行い、評価損益を中間連結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)

			2014年9月末				2015年9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	—	—	—	—	54,296	—	1,257	1,257
取引所		買建	—	—	—	—	—	—	—	—
	株式指数オプション	売建	—	—	—	—	19,072	—	24	60
		買建	—	—	—	—	22,472	—	335	△602
合計			/	/	—	—	/	/	1,568	715

(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)

	2014年9月末						2015年9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	43,752	—	—	—	261,779	—	△2,862	△2,862
取引所		買建	4,375	—	△0	△0	13,650	—	195	195
	債券先物オプション	売建	—	—	—	—	11,995	—	73	△52
		買建	—	—	—	—	—	—	—	—
合計			/	/	△0	△0	/	/	△2,739	△2,719

(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。

■商品関連取引

2014年9月末、2015年9月末とも該当ありません。

■クレジット・デリバティブ取引

2014年9月末、2015年9月末とも該当ありません。

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	2014年9月末			2015年9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	2,098,056	1,830,000	83,654	1,830,000	1,770,000	72,828
		受取変動・支払固定		606,199	595,931	△32,869	595,480	525,480	△23,799
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	35	—	△0	—	—	—
合計				/	/	50,784	/	/	49,028

(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)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	2014年9月末			2015年9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		411,546	144,494	8,868	446,988	636	16,280

(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)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

2014年9月末、2015年9月末とも該当ありません。

■債券関連取引

2014年9月末、2015年9月末とも該当ありません。