

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)

			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	2,981	—	△2	△2	—	—	—	—
取引所		買建	—	—	—	—	—	—	—	—
店頭	金利スワップ	受取固定・支払変動	71,050	70,236	1,988	1,988	99,294	97,266	3,859	3,859
		受取変動・支払固定	55,600	53,500	△1,407	△1,407	86,532	83,232	△2,658	△2,658
		受取変動・支払変動	5,000	5,000	△8	△8	5,000	5,000	12	12
	キャップ	売建	430	380	0	4	6,007	5,807	8	92
		買建	—	—	—	—	1,500	1,500	2	△20
	フロアー	売建	—	—	—	—	—	—	—	—
		買建	163	163	1	0	123	123	1	0
	スワップション	売建	40,400	28,400	1,081	△514	44,600	40,600	868	△151
		買建	26,800	26,800	449	449	31,800	31,800	86	86
合計			/	/	△60	509	/	/	425	1,220

(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)

			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		45,307	26,559	51	51	42,109	27,244	44	44
	為替予約	売建	28,495	64	△534	△534	19,358	—	352	352
		買建	27,497	72	△393	△393	18,285	—	△330	△330
	通貨オプション	売建	4,900	2,101	521	△129	4,308	659	291	△48
		買建	4,900	2,101	521	221	4,308	659	291	129
合計			/	/	△877	△785	/	/	66	147

(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	—	—	—	—	1,406	—	△18	△18
取引所		買建	—	—	—	—	—	—	—	—
	株式指数オプション	売建	—	—	—	—	—	—	—	—
		買建	—	—	—	—	6,000	—	3	△18
合計			/	/	—	—	/	/	△14	△37

(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

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	3,679	—	△1	△1	63,083	—	△177	△177
取引所 買建	—	—	—	—	—	—	—	—
合計	/	/	△1	△1	/	/	△177	△177

(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
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

2015年3月末、2016年3月末とも該当ありません。

■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)

原則的処理方法	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		
	受取固定・支払変動	350,000	315,000	1,176	365,000	165,000	4,523
	貸出金、預金等の有利 利息の金融資産・負債	45,000	40,000	△1,233	40,000	30,000	△893
金利スワップ	受取変動・支払固定						
合計		/	/	△57	/	/	3,629

(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

2015年3月末、2016年3月末とも該当ありません。

■株式関連取引

2015年3月末、2016年3月末とも該当ありません。

■債券関連取引

2015年3月末、2016年3月末とも該当ありません。