

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	2,713	—	0	0	—	—	—	—
取引所		買建	—	—	—	—	—	—	—	—
店頭	金利スワップ	受取固定・支払変動	77,559	72,559	1,965	1,965	78,490	75,748	2,355	2,355
		受取変動・支払固定	54,902	52,700	△1,428	△1,428	60,208	56,708	△1,533	△1,533
		受取変動・支払変動	5,000	5,000	△9	△9	5,000	5,000	△9	△9
	キャップ	売建	416	316	0	5	2,413	2,213	9	26
		買建	—	—	—	—	—	—	—	—
	フロアー	売建	—	—	—	—	—	—	—	—
		買建	183	183	1	0	143	143	1	0
	スワップション	売建	33,200	24,200	808	△390	43,200	34,200	1,184	△523
		買建	22,600	22,600	295	295	26,900	26,900	391	391
合計			/	/	15	438	/	/	11	708

- (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		49,630	29,561	73	73	37,474	18,890	40	40
	為替予約	売建	41,593	—	△779	△779	39,682	21	△65	△65
		買建	36,978	—	92	92	38,271	23	△37	△37
	通貨オプション	売建	5,624	2,934	475	14	4,201	1,205	399	△98
		買建	5,624	2,934	475	96	4,201	1,205	399	175
合計			/	/	△614	△503	/	/	△62	14

- (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	株式指数オプション	売建	—	—	—	—	—	—	—	—
取引所		買建	—	—	—	—	8,225	—	45	△93
合計			/	/	—	—	/	/	45	△93

- (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	24,062	—	△1	△1	5,032	—	△4	△4
取引所		買建	—	—	—	—	—	—	—	—
合計			/	/	△1	△1	/	/	△4	△4

(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)

			2014年9月末			2015年9月末		
			主なヘッジ対象		時価	契約額等		時価
						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	290,000	290,000	1,469	400,000	365,000	2,062
		貸出金、預金等の有利 利息の金融資産・負債	50,000	40,000	△1,692	40,000	35,000	△1,210
合計			/	/	△223	/	/	851

(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

2014年9月末、2015年9月末とも該当ありません。

■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。