

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)

店頭		2017年9月末				2018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			
金利スワップ	受取固定・支払変動	174,238	169,717	4,461	4,461	214,467	207,983	3,969	3,969
	受取変動・支払固定	161,775	159,775	△1,788	△1,788	201,097	189,097	△545	△545
	受取変動・支払変動	35,000	35,000	△26	△26	79,000	79,000	5	5
キャップ	売建	6,287	6,229	15	79	4,949	4,938	15	59
	買建	2,500	2,500	5	△17	3,500	3,500	18	△13
スワップション	売建	28,900	28,900	1,385	△685	45,810	45,810	2,707	△1,185
	買建	28,900	28,900	1,305	1,305	45,810	45,810	2,577	2,577
合計		/	/	2,557	3,329	/	/	3,302	4,867

(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)

店頭		2017年9月末				2018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			
通貨スワップ		32,385	24,991	25	25	33,088	19,058	23	23
	為替予約								
	売建	36,550	32	△297	△297	18,292	310	△204	△204
	買建	35,934	—	364	364	17,405	—	265	265
通貨オプション	売建	5,091	1,319	130	46	14,280	8,424	439	173
	買建	5,091	1,319	130	21	14,280	8,424	438	△17
合計		/	/	91	158	/	/	83	240

(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)

金融商品	取引所	2017年9月末				2018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			
	株式指数オプション	—	—	—	—	—	—	—	—
	売建	—	—	—	—	—	—	—	—
	買建	9,625	—	57	2	—	—	—	—
合計		/	/	57	2	/	/	—	—

(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)

	2017年9月末						2018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	37,708	—	121	121	3,000	—	△1	△1		
取引所		買建	6,889	—	—	—	—	—	—	—		
	債券先物オプション	売建	—	—	—	—	60,242	—	65	△6		
		買建	44	—	24	△19	105,086	—	182	△24		
店頭	債券店頭オプション	売建	—	—	—	—	29,294	—	24	1		
		買建	—	—	—	—	29,294	—	40	14		
合計			/	/	146	102	/	/	131	△17		

(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、大阪取引所等における最終の価格によっております。店頭取引については、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

2017年9月末、2018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

2017年9月末、2018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)

原則的処理方法	主なヘッジ対象	2017年9月末			2018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			
	金利スワップ	受取固定・支払変動	135,000	125,000	2,994	225,000	210,000	1,293
		貸出金、預金等の有利 利息の金融資産・負債	605,000	575,000	4,058	585,000	585,000	5,883
合計		/	/	7,053	/	/	7,176	

(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)

原則的処理方法	主なヘッジ対象	2017年9月末			2018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		
通貨スワップ	外貨建の貸出金、預金等の 金融資産・負債	—	—	—	3,983	3,983	△1

(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

2017年9月末、2018年9月末とも該当ありません。

■債券関連取引

2017年9月末、2018年9月末とも該当ありません。