

デリバティブ取引の状況【単体】

デリバティブ取引関係

1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引について、取引の対象物の種類ごとの決算日における契約額又は契約において定められた元本相当額、時価及び評価損益並びに当該時価の算定方法は、次のとおりであります。なお、契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

(1) 金利関連取引
前事業年度

(単位:百万円)

| 区 分 | 種 類 | 契約額等 | 契約額等のうち1年超のもの | 時 価 | 評価損益 |
|-----|-------------|--------|---------------|------|------|
| 店 頭 | 金 利 ス ワ ッ プ | | | | |
| | 受取変動・支払固定 | 13,620 | 13,620 | △328 | △328 |
| | 受取固定・支払変動 | 13,489 | 13,489 | 431 | 431 |
| | 合 計 | — | — | 102 | 102 |

(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。

当事業年度

(単位:百万円)

| 区 分 | 種 類 | 契約額等 | 契約額等のうち1年超のもの | 時 価 | 評価損益 |
|-----|-------------|--------|---------------|------|------|
| 店 頭 | 金 利 ス ワ ッ プ | | | | |
| | 受取変動・支払固定 | 15,832 | 15,559 | △405 | △405 |
| | 受取固定・支払変動 | 15,710 | 15,437 | 506 | 506 |
| | 合 計 | — | — | 101 | 101 |

(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。

(2) 通貨関連取引
前事業年度

(単位:百万円)

| 区 分 | 種 類 | 契約額等 | 契約額等のうち1年超のもの | 時 価 | 評価損益 |
|-----|---------------|---------|---------------|-------|------|
| 店 頭 | 通 貨 ス ワ ッ プ | 630,870 | 583,214 | 156 | 156 |
| | 為 替 予 約 | | | | |
| | 売 建 | 232,150 | 180 | △41 | △41 |
| | 買 建 | 16,732 | — | 432 | 432 |
| | 通 貨 オ プ シ ョ ン | | | | |
| | 売 建 | 18,810 | 8,204 | 1,583 | 403 |
| 買 建 | 18,810 | 8,204 | 1,583 | △247 | |
| | 合 計 | — | — | 3,713 | 703 |

(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。

当事業年度

(単位:百万円)

| 区 分 | 種 類 | 契約額等 | 契約額等のうち1年超のもの | 時 価 | 評価損益 |
|-----|---------------|---------|---------------|-------|-------|
| 店 頭 | 通 貨 ス ワ ッ プ | 794,097 | 674,031 | 57 | 57 |
| | 為 替 予 約 | | | | |
| | 売 建 | 138,267 | 2,028 | 3,855 | 3,855 |
| | 買 建 | 19,961 | 1,747 | △823 | △823 |
| | 通 貨 オ プ シ ョ ン | | | | |
| | 売 建 | 28,510 | 17,991 | 1,535 | 413 |
| 買 建 | 28,510 | 17,991 | 1,535 | △203 | |
| | 合 計 | — | — | 6,159 | 3,299 |

(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。

(3) 株式関連取引
該当ありません。

(4) 債券関連取引
前事業年度

(単位:百万円)

| 区 分 | 種 類 | 契約額等 | 契約額等のうち1年超のもの | 時 価 | 評価損益 |
|---------|---------|-------|---------------|-------|------|
| 金融商品取引所 | 債 券 先 物 | | | | |
| | 売 建 | 1,177 | — | 1,177 | △0 |
| | 買 建 | — | — | — | — |
| | 合 計 | — | — | 1,177 | △0 |

(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

大阪取引所における最終の価格によっております。

当事業年度

(単位:百万円)

| 区 分 | 種 類 | 契約額等 | 契約額等のうち1年超のもの | 時 価 | 評価損益 |
|---------|---------|------|---------------|-----|------|
| 金融商品取引所 | 債 券 先 物 | | | | |
| | 売 建 | 904 | — | 907 | △3 |
| | 買 建 | — | — | — | — |
| | 合 計 | — | — | 907 | △3 |

(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

大阪取引所における最終の価格によっております。

(5) 商品関連取引
該当ありません。

(6) クレジットデリバティブ取引
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

ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引について、取引の対象物の種類ごと、ヘッジ会計の方法別の決算日における契約額又は契約において定められている元本相当額及び時価並びに当該時価の算定方法は、次のとおりであります。なお、契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

(1) 金利関連取引

前事業年度

(単位:百万円)

| ヘッジ会計の方法 | 種 類 | ヘッジ対象 | 契約額等 | 契約額等のうち1年超のもの | 時 価 |
|----------|--------------------------|---------------------|---------|---------------|--------|
| 原則的処理方法 | 金 利 ス ワ ッ プ 受取変動・支払固定 | 貸出金、その他 有価証券(債券) | 113,213 | 107,922 | △7,292 |
| | 合 計 | — | — | — | △7,292 |

(注) 1. 「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 平成14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。

当事業年度

(単位:百万円)

| ヘッジ会計の方法 | 種 類 | ヘッジ対象 | 契約額等 | 契約額等のうち1年超のもの | 時 価 |
|----------|--------------------------|---------------------|---------|---------------|--------|
| 原則的処理方法 | 金 利 ス ワ ッ プ 受取変動・支払固定 | 貸出金、その他 有価証券(債券) | 108,905 | 94,564 | △9,729 |
| | 合 計 | — | — | — | △9,729 |

(注) 1. 「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 平成14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。

(2) 通貨関連取引

前事業年度

(単位:百万円)

| ヘッジ会計の方法 | 種 類 | ヘッジ対象 | 契約額等 | 契約額等のうち1年超のもの | 時 価 |
|----------|-----------------|--------|-------|---------------|-----|
| 原則的処理方法 | 資 金 関 連 ス ワ ッ プ | コールローン | 8,411 | — | 2 |
| | 合 計 | — | — | — | 2 |

(注) 1. 「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 平成14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。

当事業年度

(単位:百万円)

| ヘッジ会計の方法 | 種 類 | ヘッジ対象 | 契約額等 | 契約額等のうち1年超のもの | 時 価 |
|----------|-----------------|--------|-------|---------------|-----|
| 原則的処理方法 | 資 金 関 連 ス ワ ッ プ | コールローン | 3,380 | — | 0 |
| | 合 計 | — | — | — | 0 |

(注) 1. 「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 平成14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。

(3) 株式関連取引

該当ありません。

(4) 債券関連取引

該当ありません。