デリバティブ情報

1.ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

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中間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

（単位：百万円）

区分	種類	平成27年9月30日				平成28年9月30日			
		契約額等	うち1年超	時価	評価損益	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
金融商品取引所	金利先物	—	—	—	—	—	—	—	—
	金利オプション	—	—	—	—	—	—	—	—
店頭	金利先渡契約	—	—	—	—	—	—	—	—
	金利スワップ								
	受取固定・支払変動	—	—	—	—	—	—	—	—
	受取変動・支払固定	4,419	3,416	△109	△109	2,841	2,216	△65	△65
	受取変動・支払変動	—	—	—	—	—	—	—	—
	金利オプション	—	—	—	—	—	—	—	—
	その他	—	—	—	—	—	—	—	—
合計		—	—	△109	△109	—	—	△65	△65

（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
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。

（2）通貨関連取引

（単位：百万円）

区分	種類	平成27年9月30日				平成28年9月30日			
		契約額等	うち1年超	時価	評価損益	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
金融商品取引所	通貨先物	—	—	—	—	—	—	—	—
	通貨オプション	—	—	—	—	—	—	—	—
店頭	通貨スワップ	45,522	—	238	238	41,571	—	242	242
	為替予約								
	売建	3,219	237	△182	△182	2,583	117	109	109
	買建	5,230	235	201	201	1,561	116	△43	△43
	通貨オプション	—	—	—	—	—	—	—	—
	その他	—	—	—	—	—	—	—	—
合計		—	—	257	257	—	—	308	308

（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。

（3）株式関連取引、（4）債券関連取引、（5）商品関連取引及び（6）クレジット・デリバティブ取引については該当事項はありません。

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中間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

（単位：百万円）

ヘッジ会計の方法	種類	平成27年9月30日				平成28年9月30日			
		主なヘッジ対象	契約額等	うち1年超	時価	主なヘッジ対象	契約額等	うち1年超	時価
原則的処理方法	金利スワップ	貸出金、その他有価証券（債券）				貸出金、その他有価証券（債券）			
	受取固定・支払変動		—	—	—		—	—	—
	受取変動・支払固定		61,359	58,708	△1,804		50,104	47,063	△3,146
金利スワップの特例処理	金利スワップ	貸出金				貸出金			
	受取固定・支払変動		—	—	—		—	—	—
	受取変動・支払固定		4,923	4,923	△249		4,037	3,397	△195
合計		—	—	—	△2,053	—	—	—	△3,342

（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　平成24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
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。

（2）通貨関連取引、（3）株式関連取引及び（4）債券関連取引については該当事項はありません。