

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

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28年度中間期 (平成28年9月30日現在)				平成29年度中間期 (平成29年9月30日現在)			
		契約額等	契約額等のうち 1年超のもの	時 価	評価損益	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								
	受取固定・ 支払変動	—	—	—	—	—	—	—	—
	受取変動・ 支払固定	—	—	—	—	—	—	—	—
	受取固定・ 支払固定	500	500	△ 15	△ 15	—	—	—	—
合 計		—	—	△ 15	△ 15	—	—	—	—

(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。

(2) 通貨関連取引

(単位 百万円)

区 分	種 類	平成28年度中間期 (平成28年9月30日現在)				平成29年度中間期 (平成29年9月30日現在)			
		契約額等	契約額等のうち 1年超のもの	時 価	評価損益	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	為替予約								
	売建	—	—	—	—	109	—	△ 4	△ 4
	買建	70	—	0	0	63	—	0	0
合 計		—	—	0	0	—	—	△ 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
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。

(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

(単位 百万円)

区 分	種 類	平成28年度中間期 (平成28年9月30日現在)				平成29年度中間期 (平成29年9月30日現在)			
		契約額等	契約額等のうち 1年超のもの	時 価	評価損益	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	クレジット・デフォルト・スワップ								
	売建	500	500	0	0	—	—	—	—
	買建	—	—	—	—	—	—	—	—
合 計		—	—	0	0	—	—	—	—

(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
オプション価格計算モデルにより算定しております。
3. 「売建」は信用リスクの引受取引、「買建」は信用リスクの引渡取引であります。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

該当ありません。