営業の状況[デリバティブ取引等情報]

デリバティブ取引情報

〔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

区　分	平成27年9月30日	平成28年9月30日
金利関連取引	該当ありません。	該当ありません。

2. 通貨関連取引

(単位:百万円)

区　分			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	売建	—	—	—	—	—	—	—	—
		買建	—	—	—	—	—	—	—	—
	通貨オプション	売建	—	—	—	—	—	—	—	—
		買建	—	—	—	—	—	—	—	—
店　頭	通貨スワップ		—	—	—	—	—	—	—	—
	為替予約	売建	—	—	—	—	102	—	0	0
		買建	49	—	0	0	75	—	0	0
	通貨オプション	売建	—	—	—	—	—	—	—	—
		買建	—	—	—	—	—	—	—	—
	その他	売建	—	—	—	—	—	—	—	—
		買建	—	—	—	—	—	—	—	—
合　計					0	0			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
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

区　分	平成27年9月30日	平成28年9月30日
株式関連取引	該当ありません。	該当ありません。

4. 債券関連取引

区　分	平成27年9月30日	平成28年9月30日
債券関連取引	該当ありません。	該当ありません。

5. 商品関連取引

区　分	平成27年9月30日	平成28年9月30日
商品関連取引	該当ありません。	該当ありません。

6. クレジット・デリバティブ取引

区　分	平成27年9月30日	平成28年9月30日
クレジット・デリバティブ取引	該当ありません。	該当ありません。

〔ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引〕

該当事項はありません。

先物外国為替取引情報

(単位:百万円)

区　分	平成27年9月30日		平成28年9月30日	
	契約金額・想定元本額	信用リスク相当額	契約金額・想定元本額	信用リスク相当額
先物外国為替取引	49	—	177	1
合　計	49	—	177	1

(注)1.自己資本比率については国内基準を採用しておりますが、上記計数は国際統一基準に基づくもので、信用リスク(取引相手が契約不履行に陥った場合に被る可能性のある損失額)相当額の算出に当たってはカレント・エクスポージャー方式を採用しております。
2.信用リスク相当額については、ネッティング(取引相手と結んだ全てのオフ・バランス取引の時価評価額を相殺し、ネットアウト後の金額を信用リスク相当額とするもの)は行っておりません。
3.なお、国際統一基準の対象となっていない取引所取引、原契約期間が5営業日以内の外国為替関連取引等の契約金額・想定元本額は下記のとおりであります。

(単位:百万円)

区　分	平成27年9月30日	平成28年9月30日
	契約金額・想定元本額	契約金額・想定元本額
先物外国為替取引	49	75
合　計	49	75