

時価情報

有価証券の時価等

前・当事業年度における有価証券の時価等は、次のとおりであります。これらには、貸借対照表の「有価証券」のほか、「商品有価証券」を含めて記載しております。

① 売買目的有価証券

(単位：百万円)

種 類	前事業年度（平成26年3月31日）		当事業年度（平成27年3月31日）	
	前事業年度の損益に含まれた評価差額		当事業年度の損益に含まれた評価差額	
売買目的有価証券	0		0	

② 満期保有目的の債券 該当ありません。

③ 子会社株式等及び関連会社株式

前事業年度

子会社株式等及び関連会社株式（貸借対照表計上額 子会社株式等1,984百万円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載していません。

当事業年度

子会社株式等及び関連会社株式（貸借対照表計上額 子会社株式等1,801百万円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載していません。

④ その他有価証券

(単位：百万円)

	種 類	前事業年度（平成26年3月31日）			当事業年度（平成27年3月31日）		
		貸借対照表計上額	取得原価	差額	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が 取得原価を 超えるもの	株式	107,694	61,006	46,688	143,257	65,996	77,261
	債券	993,292	977,223	16,068	958,076	939,939	18,137
	国債	634,433	625,008	9,425	588,526	576,529	11,996
	地方債	167,474	163,028	4,445	146,088	142,350	3,738
	社債	191,384	189,187	2,197	223,461	221,059	2,402
	その他	84,314	81,720	2,593	238,897	227,092	11,804
	小計	1,185,301	1,119,951	65,350	1,340,231	1,233,028	107,203
貸借対照表計上額が 取得原価を 超えないもの	株式	20,090	23,520	△3,429	16,218	18,093	△1,874
	債券	61,802	61,887	△84	62,059	62,104	△44
	国債	32,583	32,610	△26	4,964	4,974	△9
	地方債	4,484	4,497	△12	17,540	17,547	△6
	社債	24,734	24,779	△45	39,554	39,582	△27
	その他	64,789	68,457	△3,668	32,573	36,641	△4,067
	小計	146,682	153,864	△7,182	110,851	116,838	△5,986
合 計		1,331,984	1,273,815	58,168	1,451,083	1,349,866	101,216

(注) 時価を把握することが極めて困難と認められるその他有価証券

(単位：百万円)

	前事業年度（平成26年3月31日）		当事業年度（平成27年3月31日）	
	貸借対照表計上額		貸借対照表計上額	
株式	2,545		2,524	
その他	0		0	
合 計	2,545		2,525	

これらについては、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

⑤ 前・当事業年度中に売却した満期保有目的の債券 該当ありません。

時価情報

⑥前・当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位：百万円)

種 類	前事業年度（平成26年3月期）			当事業年度（平成27年3月期）		
	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
株式	17,366	2,111	353	8,543	609	8
債券	375,219	4,645	938	298,941	3,486	1,403
国債	166,845	871	635	285,312	3,118	1,403
地方債	88,624	1,382	138	12,366	366	—
社債	119,749	2,390	164	1,262	1	—
その他	21,902	121	2,097	15,178	201	887
合 計	414,489	6,877	3,389	322,664	4,298	2,300

金銭の信託の時価等

前・当事業年度における金銭の信託の時価等は、次のとおりです。

①運用目的の金銭の信託

(単位：百万円)

種 類	前事業年度（平成26年3月31日）		当事業年度（平成27年3月31日）	
	貸借対照表計上額	当事業年度の損益に含まれた評価差額	貸借対照表計上額	当事業年度の損益に含まれた評価差額
運用目的の金銭の信託	4,901	—	4,901	—

②満期保有目的の金銭の信託 該当ありません。

③その他の金銭の信託（運用目的及び満期保有目的以外） 該当ありません。

デリバティブ取引の時価等

前・当事業年度におけるデリバティブ取引の時価等は、次のとおりであります。

- (注) 1.「契約額等」の欄には、スワップ取引につきましては想定元本額を、先物取引、オプション取引等その他の取引については契約額を記載しております。
 2.時価の算定 金融商品取引所取引につきましては、東京金融取引所等における最終の価格によっております。
 店頭取引につきましては、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。

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

(単位：百万円)

区 分	種 類	前事業年度（平成26年3月31日）				当事業年度（平成27年3月31日）			
		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
金融商品取引所	金利先物 売建・買建	—	—	—	—	—	—	—	—
	金利オプション 売建・買建	—	—	—	—	—	—	—	—
店 頭	金利先渡契約 売建・買建	—	—	—	—	—	—	—	—
	金利スワップ 受取固定・支払変動	65,044	54,355	1,165	1,165	49,276	41,587	917	917
	受取変動・支払固定	65,044	54,355	△510	△510	49,276	41,587	△430	△430
	受取変動・支払変動	—	—	—	—	—	—	—	—
	金利オプション 売建・買建	—	—	—	—	—	—	—	—
その他	売建・買建	1,813・1,813	1,615・1,615	4・4	79・△18	1,240・1,240	1,101・1,101	1・1	69・△18
合 計			663	715			490	538	

- (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 取引所取引については、東京金融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、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	前事業年度（平成26年3月31日）				当事業年度（平成27年3月31日）			
		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
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	245,670	195,950	104	104	311,216	225,509	99	99
	為替予約 売建・買建	60,163・54,292	4,836・4,271	△2,863・3,406	△2,863・3,406	68,420・61,076	600・1,081	△1,320・1,965	△1,320・1,965
	通貨オプション 売建・買建	132,872・132,872	84,772・84,772	4,435・4,435	4,109・△2,687	168,184・168,184	110,460・110,460	5,468・5,468	2,579・△1,128
	その他 売建・買建	—	—	—	—	—	—	—	—
合 計				9,518	2,069			11,681	2,195

(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

(単位：百万円)

区 分	種 類	前事業年度（平成26年3月31日）				当事業年度（平成27年3月31日）			
		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
金融商品 取引所	債券先物 売建・買建	5,793	—	8	8	4,438	—	21	21
	債券先物オプション 売建・買建	—	—	—	—	—	—	—	—
店 頭	債券店頭オプション 売建・買建	—	—	—	—	—	—	—	—
	その他 売建・買建	—	—	—	—	—	—	—	—
合 計				8	8			21	21

(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 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。

⑤商品関連取引・⑥クレジットデリバティブ取引 各該当ありません。

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	主なヘッジ対象	前事業年度（平成26年3月31日）			当事業年度（平成27年3月31日）		
			契約額等	契約額等のうち 1年超のもの	時価	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	その他有価証券 (債券)	25,000	25,000	△33	40,000	40,000	△3,169
合 計					△33			△3,169

(注) 1.主として「業種別監査委員会報告第24号」に基づき、繰延ヘッジを適用しております。
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。

②通貨関連取引

(単位：百万円)

ヘッジ会計の方法	種 類	主なヘッジ対象	前事業年度（平成26年3月31日）			当事業年度（平成27年3月31日）		
			契約額等	契約額等のうち 1年超のもの	時価	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	通貨スワップ	外貨建金銭債権等	33,963	—	△1,339	76,908	34,849	△6,105
	資金関連スワップ		70,503	—	10	62,299	—	△822
合 計					△1,328			△6,928

(注) 1.主として「業種別監査委員会報告第25号」に基づき、繰延ヘッジを適用しております。
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 各該当ありません。