

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27年3月31日)		当事業年度 (平成28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		-	

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1,801百万円) 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。

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1,718百万円) 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27年3月31日)			当事業年度 (平成28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	143,257	65,996	77,261	115,160	61,600	53,559
	債券	958,076	939,939	18,137	909,481	881,755	27,726
	国債	588,526	576,529	11,996	494,048	473,681	20,367
	地方債	146,088	142,350	3,738	152,091	147,792	4,299
	社債	223,461	221,059	2,402	263,342	260,282	3,059
	その他	238,897	227,092	11,804	241,317	232,131	9,185
	小計	1,340,231	1,233,028	107,203	1,265,959	1,175,487	90,472
貸借対照表計上額が 取得原価を 超えないもの	株式	16,218	18,093	△1,874	17,767	19,896	△2,128
	債券	62,059	62,104	△44	12,445	12,518	△73
	国債	4,964	4,974	△9	7,939	8,006	△67
	地方債	17,540	17,547	△6	3,493	3,498	△4
	社債	39,554	39,582	△27	1,012	1,013	△1
	その他	32,573	36,641	△4,067	115,433	125,853	△10,419
	小計	110,851	116,838	△5,986	145,646	158,268	△12,621
合 計	1,451,083	1,349,866	101,216	1,411,606	1,333,755	77,850	

(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27年3月31日)		当事業年度 (平成28年3月31日)	
	貸借対照表計上額		貸借対照表計上額	
株式	2,524		2,539	
その他	0		292	
合 計	2,525		2,832	

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」には含めていません。

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。

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27年3月期）			当事業年度（平成28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	8,543	609	8	4,243	1,643	0
債券	298,941	3,486	1,403	385,184	6,630	401
国債	285,312	3,118	1,403	295,725	4,917	369
地方債	12,366	366	—	74,005	1,100	32
社債	1,262	1	—	15,453	613	—
その他	15,178	201	887	95,258	1,214	5,470
合 計	322,664	4,298	2,300	484,685	9,488	5,871

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27年3月31日）		当事業年度（平成28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	—	4,895	—

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27年3月31日）				当事業年度（平成28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	49,276	41,587	917	917	31,546	26,927	839	839
		受取変動・支払固定	49,276	41,587	△430	△430	31,546	26,927	△557	△557
		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	1,240・1,240	1,101・1,101	1・1	69・△18	753・753	576・576	0・0	54・△15	
合 計			490	538			281	320		

- (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。

時価情報

②通貨関連取引

(単位：百万円)

区分	種類	前事業年度 (平成27年3月31日)				当事業年度 (平成28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	311,216	225,509	99	99	386,881	312,040	116	116
	為替予約 売建・買建	68,420・61,076	600・1,081	△1,320・1,965	△1,320・1,965	64,425・68,320	1,413・1,352	1,392・△929	1,392・△929
	通貨オプション 売建・買建	168,184・168,184	110,460・110,460	5,468・5,468	2,579・△1,128	189,611・189,611	128,286・128,286	7,400・7,400	1,277・367
	その他 売建・買建	—	—	—	—	—	—	—	—
合計				11,681	2,195			15,380	2,223

(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27年3月31日)				当事業年度 (平成28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	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				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27年3月31日)			当事業年度 (平成28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)	40,000	40,000	△3,169	60,000	60,000	△9,887
合計					△3,169			△9,887

(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27年3月31日)			当事業年度 (平成28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	76,908	34,849	△6,105	109,395	44,040	4,028
	資金関連スワップ		62,299	—	△822	61,341	—	△455
合計			—	—	△6,928	—	—	3,573

(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。