

デリバティブ取引情報

Sendai Bank

デリバティブ取引の時価等に関する事項

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9月30日				平成29年9月30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	—	—	—	—	—	—	—	—
	金利オプション	—	—	—	—	—	—	—	—
店頭	金利先渡契約	—	—	—	—	—	—	—	—
	金利スワップ 受取変動・支払固定	—	—	—	—	5,000	4,770	△ 38	△ 38
	金利オプション	—	—	—	—	—	—	—	—
合 計		—	—	—	—	—	—	△ 38	△ 38

(2) 通貨関連取引 [平成28年9月期・平成29年9月期] 該当ございません。

(3) 株式関連取引 [平成28年9月期・平成29年9月期] 該当ございません。

(4) 債券関連取引 [平成28年9月期・平成29年9月期] 該当ございません。

(5) 商品関連取引 [平成28年9月期・平成29年9月期] 該当ございません。

(6) クレジットデリバティブ取引 [平成28年9月期・平成29年9月期] 該当ございません。

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28年9月30日				平成29年9月30日			
		主なヘッジ 対象	契約額等	契約額等のうち 1年超のもの	時 価	主なヘッジ 対象	契約額等	契約額等のうち 1年超のもの	時 価
金利スワップの 特例処理	金利スワップ	貸出金	—	—	(注)	貸出金	—	—	(注)
	受取固定・支払変動	—	—	—	—	—	—	—	—
	受取変動・支払固定	—	298	—	—	—	—	—	—
合 計		—	—	—	—	—	—	—	—

(注) 金利スワップの特例処理によるものは、ヘッジ対象とされている貸出金と一体として処理されているため、その時価は本表に記載しておりません。

(2) 通貨関連取引 [平成28年9月期・平成29年9月期] 該当ございません。

(3) 株式関連取引 [平成28年9月期・平成29年9月期] 該当ございません。

(4) 債券関連取引 [平成28年9月期・平成29年9月期] 該当ございません。