

## 6. デリバティブ取引(ヘッジ会計適用分)の概要【三井住友銀行単体】

(億円)

	15年3月末				14年3月末			
	資産	負債	ネット 評価損益	ネット 繰延利益	資産	負債	ネット 評価損益	ネット 繰延利益
金利スワップ	3,985	1,752	2,233	1,173	7,500	2,843	4,657	988
通貨スワップ	4,195	4,080	115	96	4,380	4,141	239	173
その他	589	315	274	289	357	406	49	231
合計	8,769	6,147	2,622	1,558	12,237	7,390	4,847	930

- (注) 1. デリバティブ取引については、「金利スワップの特例処理」を適用しているものを除き、時価をもって貸借対照表価額としております。  
2. ヘッジ会計の方法として、主にマクロヘッジの一手法である「リスク調整アプローチ」を適用し、繰延ヘッジ会計処理を行っております。

(補足)金利スワップ(繰延ヘッジ会計適用分)の残存期間別想定元本は以下のとおりであります。

(億円)

	15年3月末				14年3月末			
	1年以内	1年超 5年以内	5年超	合計	1年以内	1年超 5年以内	5年超	合計
受取固定・支払変動	200,631	221,880	65,887	488,398	269,898	238,946	27,543	536,387
受取変動・支払固定	120,756	145,976	35,098	301,830	157,862	95,303	28,014	281,179
受取変動・支払変動	52	8,666	845	9,563	1,335	6,515	2,451	10,301
金利スワップ想定元本合計	321,439	376,522	101,830	799,791	429,095	340,764	58,008	827,867