

6. デリバティブ取引(繰延ヘッジ会計適用分)の概要 【三井住友銀行単体】

(金額単位 億円)

		16年9月末				16年3月末			
		資産	負債	ネット 資産	ネット 繰延利益	資産	負債	ネット 資産	ネット 繰延利益
	金利スワップ	665	780	115	712	990	1,065	75	591
	通貨スワップ	15	12	3	34	15	39	24	47
	その他	39	108	69	191	23	73	50	16
	合計	719	900	181	869	1,028	1,177	149	528

(注) 1. デリバティブ取引については、時価をもって(中間)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、金融商品会計実務指針に基づく個別の繰延ヘッジ又は時価ヘッジのほか、日本公認会計士協会業種別監査委員会報告第24号及び第25号に基づく銀行業固有の繰延ヘッジを適用しております。

(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。

(金額単位 億円)

		16年9月末				16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	72,788	173,844	35,988	282,620	37,689	201,680	43,076	282,445
	受取変動・支払固定	17,176	48,055	35,755	100,986	8,650	30,899	44,604	84,153
	受取変動・支払変動	350	5,720	508	6,578	10	6,130	508	6,648
	金利スワップ 想定元本合計	90,314	227,619	72,251	390,184	46,349	238,709	88,188	373,246