

4. デリバティブ取引の定量的情報

(1) 差損益の内訳(ヘッジ会計適用分・非適用分の内訳)

(単位:百万円)

区 分	2021年度末					
	金利関連	通貨関連	株式関連	債券関連	その他	合計
ヘッジ会計適用分	17,411	△377,845	—	—	—	△360,434
ヘッジ会計非適用分	△3,405	△86,367	282	—	—	△89,490
合 計	14,006	△464,213	282	—	—	△449,924

(単位:百万円)

区 分	2022年度末					
	金利関連	通貨関連	株式関連	債券関連	その他	合計
ヘッジ会計適用分	△30,478	△35,438	—	—	—	△65,917
ヘッジ会計非適用分	732	△26,827	281	884	—	△24,929
合 計	△29,746	△62,266	281	884	—	△90,847

(注) ヘッジ会計適用分のうち時価ヘッジ適用分の差損益(2021年度末:通貨関連△365,831百万円、2022年度末:通貨関連△21,036百万円)およびヘッジ会計非適用分の差損益は、損益計算書に計上しています。

(2) ヘッジ会計が適用されていないもの

○金利関連

(単位:百万円)

店 頭	区 分	2021年度末				2022年度末			
		契約額等		時価	差損益	契約額等		時価	差損益
			うち1年超				うち1年超		
	金利スワップ 固定金利受取/変動金利支払	116,300	116,300	△3,405	△3,405	18,600	18,600	732	732
	合 計				△3,405				732

(注) 金利スワップの差損益は、時価を記載しています。

【ご参考】金利スワップ契約の残存期間別構成

(単位:百万円、%)

区 分		2021年度末						
		1年以下	1年超 3年以下	3年超 5年以下	5年超 7年以下	7年超 10年以下	10年超	合計
固定金利受取 変動金利支払 スワップ	想 定 元 本	—	—	—	—	—	116,300	116,300
	平均受取金利	—	—	—	—	—	0.56	0.56
	平均支払金利	—	—	—	—	—	△0.01	△0.01

(単位:百万円、%)

区 分		2022年度末						
		1年以下	1年超 3年以下	3年超 5年以下	5年超 7年以下	7年超 10年以下	10年超	合計
固定金利受取 変動金利支払 スワップ	想 定 元 本	—	—	—	—	—	18,600	18,600
	平均受取金利	—	—	—	—	—	1.16	1.16
	平均支払金利	—	—	—	—	—	△0.02	△0.02

○通貨関連

(単位:百万円)

区 分	2021年度末				2022年度末				
	契約額等	うち1年超	時価	差損益	契約額等	うち1年超	時価	差損益	
店	為替予約								
	売建	1,134,865	—	△82,880	△82,880	19,940	—	△33	△33
	米ドル	904,313	—	△73,420	△73,420	10,764	—	△8	△8
	ユーロ	114,601	—	△3,178	△3,178	6,058	—	△31	△31
	豪ドル	115,613	—	△6,282	△6,282	3,117	—	6	6
	その他	337	—	1	1	—	—	—	—
	買建	249,356	—	4,373	4,373	150,812	—	△8,625	△8,625
	米ドル	164,709	—	4,400	4,400	145,667	—	△8,645	△8,645
	ユーロ	35,252	—	△45	△45	3,574	—	22	22
	豪ドル	49,051	—	18	18	1,569	—	△3	△3
その他	341	—	△0	△0	—	—	—	—	
頭	通貨オプション								
	売建								
	コール	493,358	—			1,650,751	—		
	(907)			14,900	△13,993	(26,965)		26,614	350
	米ドル	493,358	—			1,514,851	—		
	(907)			14,900	△13,993	(26,621)		26,310	310
	ユーロ	—	—			135,900	—		
	(-)			—	—	(344)		303	40
	買建	444,806	—			1,550,549	—		
	プット	(907)		77	△830	(26,965)		9,015	△17,949
米ドル	444,806	—			1,437,698	—			
(907)			77	△830	(26,621)		8,969	△17,651	
ユーロ	—	—			112,851	—			
(-)			—	—	(344)		46	△297	
通貨スワップ									
円払/豪ドル受	93,320	93,320	5,170	5,170	130,750	130,750	△965	△965	
円払/米ドル受	38,400	38,400	1,792	1,792	71,930	71,930	396	396	
合 計				△86,367					△26,827

(注) 1. 為替予約および通貨スワップの差損益は、時価を記載しています。

2. 通貨オプションの差損益は、オプション料と時価との差額を記載しています。

3. ()内には、貸借対照表に計上したオプション料を記載しています。

○株式関連

(単位:百万円)

区 分	2021年度末				2022年度末				
	契約額等	うち1年超	時価	差損益	契約額等	うち1年超	時価	差損益	
取引所	株価指数先物								
	売建	1,580	—	△35	△35	—	—	—	
	買建	4,159	—	201	201	5,322	—	146	146
	外国株価指数先物								
売建	—	—	—	—	2,817	—	△43	△43	
買建	4,117	—	116	116	3,716	—	177	177	
合 計				282				281	

(注) 1. 株価指数先物および外国株価指数先物の差損益は、時価を記載しています。

○債券関連

(単位:百万円)

区 分	2021年度末				2022年度末				
	契約額等	うち1年超	時価	差損益	契約額等	うち1年超	時価	差損益	
取引所	外国債券先物								
	売建	—	—	—	—	4,575	—	△130	△130
買建	—	—	—	—	50,723	—	1,176	1,176	
店頭	債券店頭オプション								
	売建								
	コール	—	—	—	—	10,000	—		
	(-)			—	—	(153)		211	△57
買建	—	—	—	—	10,000	—			
プット	(-)		—	—	(169)		65	△104	
合 計				—					884

(注) 1. 外国債券先物の差損益は、時価を記載しています。

2. 債券店頭オプションの差損益は、オプション料と時価との差額を記載しています。

3. ()内には、貸借対照表に計上したオプション料を記載しています。

(3)ヘッジ会計が適用されているもの

○金利関連

(単位:百万円)

ヘッジ会計の方法	種類	主なヘッジ対象	2021年度末		
			契約額等		時価
				うち1年超	
繰延ヘッジ	金利スワップ 固定金利受取/変動金利支払	保険負債	672,200	668,900	17,322
金利スワップの特例処理	金利スワップ 固定金利受取/変動金利支払	貸付金	3,018	3,018	89
合 計					17,411

(単位:百万円)

ヘッジ会計の方法	種類	主なヘッジ対象	2022年度末		
			契約額等		時価
				うち1年超	
繰延ヘッジ	金利スワップ 固定金利受取/変動金利支払	保険負債	875,500	872,300	△30,534
金利スワップの特例処理	金利スワップ 固定金利受取/変動金利支払	貸付金	2,916	2,916	55
合 計					△30,478

(注)金利スワップの差損益は、時価を記載しています。

【ご参考】金利スワップ契約の残存期間別構成

(単位:百万円、%)

区 分		2021年度末						合計
		1年以下	1年超 3年以下	3年超 5年以下	5年超 7年以下	7年超 10年以下	10年超	
固定金利受取	想 定 元 本	3,300	7,418	9,500	7,900	9,000	638,100	675,218
変動金利支払	平均受取金利	1.75	1.75	1.82	2.09	2.10	0.75	0.82
スワップ	平均支払金利	0.05	0.12	0.12	0.05	0.05	△0.00	0.00

(単位:百万円、%)

区 分		2022年度末						合計
		1年以下	1年超 3年以下	3年超 5年以下	5年超 7年以下	7年超 10年以下	10年超	
固定金利受取	想 定 元 本	3,200	6,416	7,400	7,900	18,800	834,700	878,416
変動金利支払	平均受取金利	1.75	1.63	2.03	2.15	1.94	0.73	0.79
スワップ	平均支払金利	0.04	0.21	0.04	0.04	0.04	0.01	0.02

○通貨関連

(単位:百万円)

ヘッジ会計の方法	種類	主なヘッジ対象	2021年度末			2022年度末		
			契約額等	うち1年超	時価	契約額等	うち1年超	時価
時価ヘッジ	為替予約 売建	外貨建 債券	4,558,542	—	△365,831	3,916,592	—	△21,036
	米ドル		3,225,926	—	△237,894	2,972,665	—	△23,342
	豪ドル		1,033,020	—	△115,185	633,474	—	8,963
	ユーロ		213,676	—	△6,309	271,655	—	△6,396
	その他		85,918	—	△6,441	38,796	—	△261
繰延ヘッジ	通貨スワップ	外貨建 債券						
	米ドル		81,785	76,594	△8,811	76,594	76,594	△12,494
	ユーロ		35,575	35,575	△2,543	35,575	35,575	△1,793
	豪ドル	12,404	12,404	△658	12,404	12,404	△114	
合 計				△377,845			△35,438	

(注) 為替予約等が付されていることにより、決済時における円貨額が確定し、貸借対照表において当該円貨額で表示されている外貨建金銭債権債務等にかかる取引を除いています。

○株式関連

2021年度末および2022年度末とも保有していません。

○債券関連

2021年度末および2022年度末とも保有していません。