

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	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

(単位:百万円)

区 分	2023年度第2四半期(上半期)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	△89,845	△251,280	—	—	—	△341,126
ヘッジ会計非適用分	△3,822	△48,613	△157	△2,223	—	△54,818
合 計	△93,668	△299,894	△157	△2,223	—	△395,944

(注) ヘッジ会計適用分のうち時価ヘッジ適用分の差損益(2022年度末:通貨関連△21,036百万円、2023年度第2四半期(上半期)末:通貨関連△223,019百万円)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せん。

(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	2022年度末				2023年度第2四半期(上半期)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
	金利スワップ 固定金利受取/変動金利支払	18,600	18,600	732	732	105,400	105,400	△3,822	△3,822
	合 計				732				△3,822

(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		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 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

(単位:百万円、%)

区 分		2023年度第2四半期(上半期)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 変動金利支払 スワップ	想 定 元 本	—	—	3,700	—	28,900	72,800	105,400
	平均受取金利	—	—	2.08	—	0.63	0.82	0.81
	平均支払金利	—	—	△0.00	—	△0.06	△0.06	△0.06

○通貨関連

(単位:百万円)

区 分	2022年度末				2023年度第2四半期(上半期)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
為替予約								
売建	19,940	—	△33	△33	12,802	—	△143	△143
米ドル	10,764	—	△8	△8	10,124	—	△97	△97
豪ドル	3,117	—	6	6	1,981	—	△43	△43
ユーロ	6,058	—	△31	△31	534	—	△3	△3
その他	—	—	—	—	161	—	0	0
買建	150,812	—	△8,625	△8,625	237,084	—	4,381	4,381
米ドル	145,667	—	△8,645	△8,645	231,825	—	4,260	4,260
豪ドル	1,569	—	△3	△3	3,997	—	119	119
ユーロ	3,574	—	22	22	1,261	—	1	1
店頭								
通貨オプション								
売建								
コール	1,650,751	—	—	—	1,951,160	—	—	—
	(26,965)	—	26,614	350	(31,331)	—	68,571	△37,239
米ドル	1,514,851	—	—	—	1,801,310	—	—	—
	(26,621)	—	26,310	310	(31,098)	—	68,533	△37,434
ユーロ	135,900	—	—	—	149,850	—	—	—
	(344)	—	303	40	(232)	—	37	194
買建								
ブット	1,550,549	—	—	—	1,911,428	—	—	—
	(26,965)	—	9,015	△17,949	(31,331)	—	6,528	△24,802
米ドル	1,437,698	—	—	—	1,786,850	—	—	—
	(26,621)	—	8,969	△17,651	(31,098)	—	6,509	△24,589
ユーロ	112,851	—	—	—	124,578	—	—	—
	(344)	—	46	△297	(232)	—	19	△213
通貨スワップ								
円払/豪ドル受	130,750	130,750	△965	△965	140,590	140,590	4,477	4,477
円払/米ドル受	71,930	71,930	396	396	86,200	86,200	4,713	4,713
合 計				△26,827				△48,613

- (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	2022年度末				2023年度第2四半期(上半期)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	—	—	—	—	1,216	—	31	31
買建	5,322	—	146	146	6,464	—	△74	△74
外国株価指数先物								
売建	2,817	—	△43	△43	505	—	19	19
買建	3,716	—	177	177	4,107	—	△133	△133
合 計				281				△157

- (注) 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	2022年度末				2023年度第2四半期(上半期)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	30,442	—	△589	△589
店頭								
債券店頭オプション								
売建								
コール	10,000	—	—	—	—	—	—	—
	(153)	—	211	△57	(-)	—	—	—
ブット	—	—	—	—	100,000	—	2,011	△1,634
	(-)	—	—	—	(377)	—	—	—
買建								
ブット	10,000	—	65	△104	—	—	—	—
	(169)	—	—	—	(-)	—	—	—
合 計				884				△2,223

- (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	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

(単位:百万円)

ヘッジ会計の方法	種類	主なヘッジ対象	2023年度第2四半期(上半期)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	922,700	922,700	△89,889
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	2,865	2,300	43
合 計					△89,845

(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		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

(単位:百万円、%)

区 分		2023年度第2四半期(上半期)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	565	5,800	3,700	7,900	55,100	852,500	925,565
変動金利支払	平均受取金利	1.20	1.68	1.98	2.15	1.04	0.73	0.78
スワップ	平均支払金利	0.77	0.13	0.01	0.00	△0.04	△0.02	△0.01

○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	2022年度末			2023年度第2四半期(上半期)末		
			契約額等	時価		契約額等	時価	
				うち1年超			うち1年超	
時価ヘッジ	為替予約 売建	外貨建 債券	3,916,592	—	△21,036	3,447,865	—	△223,019
	米ドル		2,972,665	—	△23,342	2,687,198	—	△208,036
	豪ドル		633,474	—	8,963	463,337	—	△9,853
	ユーロ		271,655	—	△6,396	260,475	—	△3,455
	その他		38,796	—	△261	36,854	—	△1,673
繰延ヘッジ	通貨スワップ	外貨建 債券						
	米ドル		76,594	76,594	△12,494	76,594	66,184	△22,381
	ユーロ		35,575	35,575	△1,793	35,575	35,575	△5,054
	豪ドル	12,404	12,404	△114	12,404	12,404	△825	
合 計					△35,438			△251,280

(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

2022年度末および2023年度第2四半期(上半期)末とも保有していません。

○債券関連

2022年度末および2023年度第2四半期(上半期)末とも保有していません。