

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	平成27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	59,990	88,255	—	—	—	148,246
ヘッジ会計非適用分	△0	△63	43	—	—	△20
合 計	59,989	88,192	43	—	—	148,225

(単位:百万円)

区 分	平成28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	66,279	63,640	—	—	—	129,919
ヘッジ会計非適用分	△0	330	△10	—	—	319
合 計	66,278	63,970	△10	—	—	130,239

(注) ヘッジ会計適用分のうち時価ヘッジ適用分の差損益(平成27年度末:通貨関連89,473百万円、平成28年度第2四半期(上半期)末:通貨関連60,855百万円)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	平成27年度末				平成28年度第2四半期(上半期)末			
		契約額等	時価		契約額等	時価		差損益	
			うち1年超	差損益		うち1年超	差損益		
	金利スワップ 固定金利受取/変動金利支払	100	100	△0	△0	100	100	△0	△0
	合 計				△0				△0

(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		平成27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	—	—	—	—	—	100	100
	平均受取金利	—	—	—	—	—	0.46	0.46
	平均支払金利	—	—	—	—	—	0.02	0.02

(単位:百万円、%)

区 分		平成28年度第2四半期(上半期)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	—	—	—	—	—	100	100
	平均受取金利	—	—	—	—	—	0.32	0.32
	平均支払金利	—	—	—	—	—	0.00	0.00

○通貨関連

(単位:百万円)

区 分	平成27年度末				平成28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	
店 頭	為替予約								
	売建	12,946	—	△103	△103	60,763	—	328	328
	米ドル	519	—	3	3	33,718	—	271	271
	豪ドル	12,226	—	△105	△105	19,102	—	△157	△157
	英ポンド	32	—	0	0	6,768	—	213	213
	その他	169	—	△1	△1	1,174	—	1	1
	買建	5,339	—	39	39	1,541	—	1	1
	ユーロ	1,641	—	46	46	828	—	1	1
	米ドル	3,572	—	△7	△7	535	—	△0	△0
	スウェーデン・クローナ	5	—	0	0	160	—	0	0
	その他	119	—	0	0	16	—	△0	△0
	合 計				△63				330

(注) 為替予約の差損益は、時価を記載しています。

○株式関連

(単位:百万円)

区 分	平成27年度末				平成28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	274	—	4	4	—	—	—	
	買建	1,824	—	21	21	2,081	—	△4	△4
	外国株価指数先物								
	売建	—	—	—	—	1,322	—	△7	△7
	買建	2,332	—	17	17	826	—	2	2
合 計				43				△10	

(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

平成27年度末および平成28年度第2四半期(上半期)末とも保有していません。

(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	平成27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	233,900	233,900	59,067
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	28,948	18,948	922
合 計					59,990

(単位:百万円)

ヘッジ会計の方法	種類	主なヘッジ対象	平成28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	232,600	232,600	65,579
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	27,851	10,851	700
合 計					66,279

【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		平成27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	10,000	15,000	4,118	7,400	16,130	210,200	262,848
変動金利支払	平均受取金利	1.95	1.97	1.51	1.68	1.73	1.89	1.88
スワップ	平均支払金利	0.22	0.23	0.01	0.04	0.16	0.06	0.08

(単位:百万円、%)

区 分		平成28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	17,000	7,272	3,800	7,400	15,479	209,500	260,451
変動金利支払	平均受取金利	1.95	1.98	1.50	1.68	1.73	1.89	1.88
スワップ	平均支払金利	0.19	0.19	△0.00	0.01	0.10	△0.00	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	平成27年度末			平成28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	2,123,031	—	89,473	1,961,243	—	60,855
	米ドル		1,808,792	—	86,840	1,680,666	—	56,163
	ユーロ		182,880	—	1,773	161,982	—	2,272
	豪ドル		131,358	—	859	118,595	—	2,420
繰延ヘッジ	通貨スワップ	外貨建 債券						
	ユーロ		35,575	35,575	△1,307	35,575	35,575	2,322
	豪ドル		4,305	4,305	89	4,305	4,305	461
合 計					88,255			63,640

(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

平成27年度末および平成28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

平成27年度末および平成28年度第2四半期(上半期)末とも保有していません。