

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	2016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	51,422	△28,235	—	—	—	23,186
ヘッジ会計非適用分	△5	632	△25	—	—	601
合 計	51,416	△27,603	△25	—	—	23,788

(単位:百万円)

区 分	2017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	51,453	78,337	—	—	—	129,790
ヘッジ会計非適用分	4	△2,558	△53	—	—	△2,608
合 計	51,457	75,778	△53	—	—	127,182

(注) ヘッジ会計適用分のうち時価ヘッジ適用分の差損益(2016年度末:通貨関連△29,786百万円、2017年度末:通貨関連79,785百万円)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	2016年度末			2017年度末				
		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		
	固定金利受取 変動金利支払 スワップ	200	200	△5	△5	1,200	1,200	4	4
	合 計				△5				4

(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		2016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	—	—	—	—	—	200	200
	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		2017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	—	—	—	—	—	1,200	1,200
	平均受取金利	—	—	—	—	—	0.68	0.68
	平均支払金利	—	—	—	—	—	0.01	0.01

○通貨関連

(単位:百万円)

区 分	2016年度末				2017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	118,008	—	592	592	88,295	—	1,768	1,768
	米ドル	106,347	—	575	575	62,385	—	1,661	1,661
	ユーロ	224	—	1	1	13,904	—	37	37
	豪ドル	4,363	—	38	38	11,454	—	68	68
	英ポンド	6,979	—	△23	△23	127	—	0	0
	その他	92	—	0	0	422	—	0	0
	買建	11,993	—	38	38	19,226	—	61	61
	米ドル	11,742	—	40	40	9,566	—	64	64
	ユーロ	146	—	△1	△1	6,914	—	△0	△0
	豪ドル	93	—	0	0	2,302	—	△0	△0
	その他	9	—	0	0	442	—	△1	△1
	頭	通貨オプション							
		売建							
コール		105,400	—	—	499	(-)	—	—	
米ドル		(499)	—	—	499	(-)	—	—	
買建									
プット		89,250	—	0	△499	(-)	—	—	
米ドル	(499)	—	0	△499	(-)	—	—		
通貨スワップ									
円払/豪ドル受	—	—	—	—	88,870	88,870	△4,389	△4,389	
合 計				632				△2,558	

(注) 1. 差損益欄には、為替予約およびスワップ取引については時価を記載し、オプション取引についてはオプション料と時価との差額を記載しています。

2. ()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	2016年度末				2017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								
	買建	2,192	—	△29	△29	2,706	—	39	39
	外国株価指数先物								
買建	1,098	—	3	3	2,820	—	△93	△93	
合 計				△25				△53	

(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

2016年度末および2017年度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	2016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	232,600	232,600	51,026
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	16,755	8,755	395
合 計					51,422

(単位:百万円)

ヘッジ会計の方法	種類	主なヘッジ対象	2017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	231,400	231,400	51,256
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	8,562	3,562	197
合 計					51,453

【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		2016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	8,000	5,227	7,500	7,500	16,028	205,100	249,355
	平均受取金利	1.90	2.12	1.56	1.75	1.79	1.89	1.87
	平均支払金利	0.21	0.20	0.02	0.03	0.12	0.02	0.04

(単位:百万円、%)

区 分		2017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	5,000	3,636	7,100	8,926	14,500	200,800	239,962
	平均受取金利	2.15	1.51	1.69	1.73	1.90	1.88	1.87
	平均支払金利	0.21	0.01	△0.00	0.11	0.06	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	2016年度末			2017年度末		
			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	2,852,379	—	△29,786	3,376,632	—	79,785
	米ドル		2,560,560	—	△23,153	3,058,604	—	76,837
	ユーロ		168,759	—	△173	183,159	—	319
	豪ドル		123,059	—	△6,459	134,867	—	2,628
繰延ヘッジ	通貨スワップ	外貨建 債券						
	ユーロ		35,575	35,575	1,472	35,575	35,575	△1,641
	豪ドル		4,305	4,305	78	4,305	4,305	192
合 計					△28,235			78,337

(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

2016年度末および2017年度末とも保有していません。

○債券関連

2016年度末および2017年度末とも保有していません。