

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	51,194	△66,131	—	—	—	△14,937
ヘッジ会計非適用分	△1	△1,649	106	—	—	△1,544
合 計	51,192	△67,781	106	—	—	△16,482

(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年度第2四半期(上半期)末:通貨関連△63,442百万円)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
	固定金利受取 変動金利支払 スワップ	200	200	△5	△5	100	100	△1	△1
	合 計				△5				△1

(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	—	—	—	—	—	0.71	0.71
	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	為替予約								
	売建	118,008	—	592	592	77,478	—	△1,874	△1,874
	米ドル	106,347	—	575	575	63,358	—	△1,268	△1,268
	英ポンド	6,979	—	△23	△23	7,104	—	△483	△483
	豪ドル	4,363	—	38	38	4,792	—	△82	△82
	その他	317	—	1	1	2,224	—	△39	△39
	買建	11,993	—	38	38	18,689	—	315	315
	米ドル	11,742	—	40	40	14,761	—	253	253
	ユーロ	146	—	△1	△1	3,191	—	60	60
	その他	103	—	0	0	736	—	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	105,400	—	—	—	—	—	—	—
	プット	(499)	—	0	△499	(-)	—	—	—
米ドル	89,250	—	0	△499	(-)	—	—	—	
通貨スワップ									
円払/豪ドル受	—	—	—	—	29,000	29,000	△90	△90	
合 計				632				△1,649	

(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								
	買建	2,192	—	△29	△29	1,845	—	80	80
	外国株価指数先物								
買建	1,098	—	3	3	1,835	—	25	25	
合 計				△25				106	

(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	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	232,500	232,500	50,921
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	10,659	3,659	272
合 計					51,194

【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	7,000	182	7,200	8,677	14,800	205,300	243,159
	平均受取金利	2.00	1.60	1.56	1.67	1.84	1.89	1.87
	平均支払金利	0.21	0.09	△0.00	0.11	0.05	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	2,852,379	—	△29,786	2,969,312	—	△63,442
	米ドル		2,560,560	—	△23,153	2,647,979	—	△54,882
	ユーロ		168,759	—	△173	183,784	—	△2,326
	豪ドル		123,059	—	△6,459	137,548	—	△6,233
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	△2,598
	豪ドル		4,305	4,305	78	4,305	4,305	△91
合 計					△28,235			△66,131

(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年度第2四半期(上半期)末とも保有していません。

○債券関連

2016年度末および2017年度第2四半期(上半期)末とも保有していません。