

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	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

(単位:百万円)

区 分	2018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	45,610	△131,673	—	—	—	△86,062
ヘッジ会計非適用分	—	△7,495	473	—	—	△7,021
合 計	45,610	△139,168	473	—	—	△93,084

(注) ヘッジ会計適用分のうち時価ヘッジ適用分の差損益(2017年度末:通貨関連79,785百万円、2018年度第2四半期(上半期)末:通貨関連△129,860百万円)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	2017年度末			2018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	
	固定金利受取 変動金利支払 スワップ	1,200	1,200	4	4	—	—	—
	合 計				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		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

(単位:百万円、%)

区 分		2018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	—	—	—	—	—	—	—
	平均受取金利	—	—	—	—	—	—	—
	平均支払金利	—	—	—	—	—	—	—

○通貨関連

(単位:百万円)

区 分	2017年度末				2018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	88,295	—	1,768	1,768	102,280	—	△3,646	△3,646
	米ドル	62,385	—	1,661	1,661	82,159	—	△3,092	△3,092
	豪ドル	11,454	—	68	68	10,029	—	△342	△342
	ユーロ	13,904	—	37	37	10,012	—	△211	△211
	英ポンド	127	—	0	0	26	—	0	0
	その他	422	—	0	0	52	—	△0	△0
	買建	19,226	—	61	61	18,837	—	103	103
	米ドル	9,566	—	64	64	9,507	—	87	87
	スウェーデン・クローナ	101	—	△0	△0	7,974	—	0	0
	ユーロ	6,914	—	△0	△0	1,009	—	12	12
	豪ドル	2,302	—	△0	△0	304	—	3	3
	その他	340	—	△0	△0	41	—	0	0
通貨スワップ									
円払/豪ドル受	88,870	88,870	△4,389	△4,389	121,279	121,279	△4,043	△4,043	
円払/米ドル受	—	—	—	—	7,170	7,170	91	91	
合 計				△2,558				△7,495	

(注) 為替予約およびスワップ取引の差損益は、時価を記載しています。

○株式関連

(単位:百万円)

区 分	2017年度末				2018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	2,706	—	39	39	6,169	—	482	482
	外国株価指数先物								
	売建	—	—	—	—	2,818	—	△32	△32
買建	2,820	—	△93	△93	2,453	—	24	24	
合 計				△53				473	

(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

2017年度末および2018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	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

(単位:百万円)

ヘッジ会計の方法	種類	主なヘッジ対象	2018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	45,456
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	3,466	3,375	154
合 計					45,610

【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		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

(単位:百万円、%)

区 分		2018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	91	3,500	7,100	8,875	14,500	202,000	236,066
	平均受取金利	1.60	1.50	1.69	1.73	1.90	1.88	1.86
	平均支払金利	0.10	0.03	0.02	0.11	0.07	0.02	0.03

○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	2017年度末			2018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	3,376,632	—	79,785	3,936,937	—	△129,860
	米ドル		3,058,604	—	76,837	3,593,056	—	△124,245
	ユーロ		183,159	—	319	189,578	—	△4,816
	豪ドル		134,867	—	2,628	146,322	—	△800
	その他		—	—	—	7,980	—	2
繰延ヘッジ	通貨スワップ	外貨建 債券						
	ユーロ		35,575	35,575	△1,641	35,575	35,575	△1,985
	豪ドル		4,305	4,305	192	4,305	4,305	172
合 計					78,337			△131,673

(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

2017年度末および2018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

2017年度末および2018年度第2四半期(上半期)末とも保有していません。