

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	2018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	57,632	△8,782	—	—	—	48,850
ヘッジ会計非適用分	4	△2,637	45	2	—	△2,585
合 計	57,637	△11,419	45	2	—	46,264

(単位:百万円)

区 分	2019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	61,637	△10,208	—	—	—	51,428
ヘッジ会計非適用分	0	△19,275	△8,598	9	—	△27,864
合 計	61,637	△29,483	△8,598	9	—	23,564

(注) ヘッジ会計適用分のうち時価ヘッジ適用分の差損益(2018年度末:通貨関連△8,600百万円、2019年度末:通貨関連△11,456百万円)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	2018年度末				2019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		
	金利スワップ 固定金利受取/変動金利支払	700	700	4	4	900	900	0	0
	合 計				4				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		2018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	—	—	—	—	—	700	700	
	平均受取金利	—	—	—	—	—	0.41	0.41	
	平均支払金利	—	—	—	—	—	0.01	0.01	

(単位:百万円、%)

区 分		2019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	—	—	—	—	—	900	900	
	平均受取金利	—	—	—	—	—	0.15	0.15	
	平均支払金利	—	—	—	—	—	△0.04	△0.04	

○通貨関連

(単位:百万円)

区 分	2018年度末				2019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	194,632	—	199	199	773,127	—	△596	△596
	米ドル	160,265	—	△23	△23	687,556	—	△4,401	△4,401
	豪ドル	20,073	—	100	100	53,582	—	3,472	3,472
	ユーロ	14,252	—	122	122	31,838	—	331	331
	その他	41	—	0	0	149	—	0	0
	買建	11,875	—	△24	△24	33,772	—	23	23
	米ドル	6,577	—	3	3	16,746	—	68	68
	ユーロ	3,864	—	△28	△28	11,451	—	△83	△83
	豪ドル	1,378	—	1	1	5,523	—	38	38
その他	55	—	△0	△0	50	—	0	0	
頭	通貨オプション								
	売建								
	コール	198,628	—			157,097	—		
		(476)		1	474	(41)		41	0
	米ドル	198,628	—			157,097	—		
		(476)		1	474	(41)		41	0
買建									
プット	178,500	—			166,178	—			
	(476)		32	△443	(63)		198	135	
米ドル	178,500	—			166,178	—			
	(476)		32	△443	(63)		198	135	
通貨スワップ									
円払/豪ドル受	154,546	154,546	△3,143	△3,143	175,156	175,156	△19,719	△19,719	
円払/米ドル受	11,740	11,740	300	300	7,080	7,080	881	881	
合 計				△2,637				△19,275	

(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。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。

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		2018年度末				2019年度末			
		契約額等		時価	差損益	契約額等		時価	差損益
			うち1年超				うち1年超		
取引所	株価指数先物								
	売建	2,672	—	△18	△18	148,066	—	△8,969	△8,969
	買建	4,154	—	0	0	8,943	—	231	231
	外国株価指数先物								
	売建	327	—	△9	△9	346	—	△35	△35
	買建	5,444	—	72	72	6,304	—	174	174
合 計					45				△8,598

(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		2018年度末				2019年度末			
		契約額等		時価	差損益	契約額等		時価	差損益
			うち1年超				うち1年超		
取引所	外国債券指数先物								
	売建	—	—	—	—	—	—	—	—
	買建	123	—	2	2	513	—	9	9
合 計					2				9

(注) 外国債券指数先物の差損益は、時価を記載しています。

(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	2018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	230,700	230,700	57,446
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	3,369	3,324	185
合 計					57,632

(単位:百万円)

ヘッジ会計の方法	種類	主なヘッジ対象	2019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	227,300	227,300	61,477
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	3,222	3,222	159
合 計					61,637

【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		2018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	45	6,300	6,800	11,124	12,300	197,500	234,069
	平均受取金利	1.60	1.56	1.75	1.73	2.05	1.87	1.86
	平均支払金利	0.07	0.01	△0.00	0.14	0.00	0.00	0.01

(単位:百万円、%)

区 分		2019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	—	6,500	8,122	10,100	12,400	193,400	230,522
	平均受取金利	—	1.68	1.74	1.83	2.13	1.86	1.86
	平均支払金利	—	△0.01	0.10	0.01	△0.01	△0.02	△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	2018年度末			2019年度末		
			契約額等	うち1年超	時価	契約額等	うち1年超	時価
時価ヘッジ	為替予約 売建	外貨建 債券	3,887,217	—	△8,600	4,679,142	—	△11,456
	米ドル		3,529,862	—	△10,393	4,169,798	—	△34,142
	ユーロ		199,793	—	700	253,887	—	1,063
	豪ドル		142,408	—	980	240,977	—	20,754
	その他		15,152	—	112	14,479	—	867
繰延ヘッジ	通貨スワップ ユーロ	外貨建 債券	35,575	35,575	△381	35,575	35,575	538
	豪ドル		4,305	4,305	199	4,305	4,305	709
合 計					△8,782			△10,208

(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

2018年度末および2019年度末とも保有していません。

○債券関連

2018年度末および2019年度末とも保有していません。