

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					合計
	金利関連	通貨関連	株式関連	債券関連	その他	
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年度第2四半期(上半期)末					合計
	金利関連	通貨関連	株式関連	債券関連	その他	
ヘッジ会計適用分	63,273	△5,338	—	—	—	57,934
ヘッジ会計非適用分	72	△3,155	16	△6	—	△3,073
合 計	63,345	△8,494	16	△6	—	54,861

(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年度第2四半期(上半期)末:通貨関連△6,065百万円)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)

区 分	2018年度末			2019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 金利スワップ 固定金利受取/変動金利支払	700	700	4	4	3,100	3,100	72	72
合 計				4				72

(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	—	—	—	—	—	700	700	
変動金利支払	—	—	—	—	—	0.41	0.41	
スワップ	—	—	—	—	—	0.01	0.01	

(単位:百万円、%)

区 分	2019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	—	3,100	—	—	—	—	3,100	
変動金利支払	—	1.50	—	—	—	—	1.50	
スワップ	—	△0.05	—	—	—	—	△0.05	

○通貨関連

(単位:百万円)

区 分	2018年度末				2019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	194,632	—	199	199	464,151	—	1,741	1,741
	米ドル	160,265	—	△23	△23	341,963	—	△727	△727
	ユーロ	14,252	—	122	122	85,376	—	1,933	1,933
	豪ドル	20,073	—	100	100	36,781	—	535	535
	その他	41	—	0	0	30	—	△0	△0
	買建	11,875	—	△24	△24	117,538	—	220	220
	ユーロ	3,864	—	△28	△28	69,271	—	217	217
	米ドル	6,577	—	3	3	46,514	—	7	7
	豪ドル	1,378	—	1	1	1,698	—	△3	△3
その他	55	—	△0	△0	54	—	△0	△0	
頭	通貨オプション								
	売建								
	コール	198,628	—			—	—		
	(476)		1	474	(-)		—	—	
	米ドル	198,628	—			—	—		
	(476)		1	474	(-)		—	—	
買建									
プット	178,500	—			—	—			
(476)		32	△443	(-)		—	—		
米ドル	178,500	—			—	—			
(476)		32	△443	(-)		—	—		
通貨スワップ									
円払/豪ドル受	154,546	154,546	△3,143	△3,143	172,376	172,376	△5,630	△5,630	
円払/米ドル受	11,740	11,740	300	300	10,540	10,540	511	511	
合 計				△2,637				△3,155	

(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	2,672	—	△18	△18	46	—	△1	△1
	買建	4,154	—	0	0	2,385	—	27	27
	外国株価指数先物								
売建	327	—	△9	△9	2,590	—	△7	△7	
買建	5,444	—	72	72	5,355	—	△2	△2	
合 計				45				16	

(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

区 分	2018年度末				2019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	外国債券指数先物							
	売建	-	-	-	-	-	-	-
買建	123	-	2	2	532	-	△6	△6
合 計				2				△6

(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	保険負債			
	固定金利受取/変動金利支払		230,700	230,700	57,446
金利スワップの特例処理	金利スワップ	貸付金			
	固定金利受取/変動金利支払		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	保険負債			
	固定金利受取/変動金利支払		227,700	227,700	63,088
金利スワップの特例処理	金利スワップ	貸付金			
	固定金利受取/変動金利支払		3,273	3,273	184
合 計					63,273

【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	—	3,200	7,773	9,800	12,300	197,900	230,973
	平均受取金利	—	1.62	1.53	1.78	2.05	1.86	1.86
	平均支払金利	—	△0.05	△0.03	0.04	△0.05	△0.03	△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	2018年度末			2019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	3,887,217	—	△8,600	4,219,684	—	△6,065
	米ドル		3,529,862	—	△10,393	3,761,035	—	△13,611
	ユーロ		199,793	—	700	233,600	—	2,393
	豪ドル		142,408	—	980	210,904	—	4,885
	その他		15,152	—	112	14,144	—	267
繰延ヘッジ	通貨スワップ	外貨建 債券						
	ユーロ		35,575	35,575	△381	35,575	35,575	374
	豪ドル		4,305	4,305	199	4,305	4,305	351
合 計					△8,782			△5,338

(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年度第2四半期(上半期)末とも保有していません。

○債券関連

2018年度末および2019年度第2四半期(上半期)末とも保有していません。