

#### 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	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

(単位:百万円)

区 分	2020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	58,047	7,408	—	—	—	65,456
ヘッジ会計非適用分	265	10,503	73	3	—	10,846
合 計	58,312	17,912	73	3	—	76,302

(注) ヘッジ会計適用分のうち時価ヘッジ適用分の差損益(2019年度末:通貨関連△11,456百万円、2020年度第2四半期(上半期)末:通貨関連9,424百万円)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 区 分	2019年度末				2020年度第2四半期(上半期)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		
金利スワップ 固定金利受取/変動金利支払	900	900	0	0	90,000	90,000	265	265
合 計				0				265

(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		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

(単位:百万円、%)

区 分		2020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	—	—	—	—	—	90,000	90,000
	平均受取金利	—	—	—	—	—	0.18	0.18
	平均支払金利	—	—	—	—	—	△0.04	△0.04

## ○通貨関連

(単位:百万円)

区 分	2019年度末				2020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	773,127	—	△596	△596	815,915	—	4,329	4,329
	米ドル	687,556	—	△4,401	△4,401	739,514	—	4,361	4,361
	豪ドル	53,582	—	3,472	3,472	52,558	—	△340	△340
	ユーロ	31,838	—	331	331	23,541	—	309	309
	その他	149	—	0	0	301	—	△0	△0
	買建	33,772	—	23	23	20,601	—	△21	△21
	米ドル	16,746	—	68	68	10,476	—	△6	△6
	ポーランドズロチ	—	—	—	—	5,408	—	24	24
	ユーロ	11,451	—	△83	△83	3,260	—	△23	△23
	豪ドル	5,523	—	38	38	1,234	—	△15	△15
	その他	50	—	0	0	222	—	△0	△0
	通貨オプション								
	売建								
	コール	157,097 (41)	—	41	0	— (-)	—	—	—
米ドル	157,097 (41)	—	41	0	— (-)	—	—	—	
買建									
プット	166,178 (63)	—	198	135	— (-)	—	—	—	
米ドル	166,178 (63)	—	198	135	— (-)	—	—	—	
通貨スワップ									
円払/豪ドル受	175,156	175,156	△19,719	△19,719	143,162	143,162	5,468	5,468	
円払/米ドル受	7,080	7,080	881	881	7,080	7,080	726	726	
合 計				△19,275				10,503	

(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	2019年度末				2020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	148,066	—	△8,969	△8,969	961	—	△13	△13
	買建	8,943	—	231	231	5,461	—	49	49
	外国株価指数先物								
	売建	346	—	△35	△35	22	—	0	0
買建	6,304	—	174	174	3,612	—	37	37	
合 計				△8,598				73	

(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	2019年度末				2020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	513	-	9	9	548	-	3
合 計				9				3

## (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	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

(単位:百万円)

ヘッジ会計の方法	種類	主なヘッジ対象	2020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	226,900	226,900	57,894
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	3,171	3,171	153
合 計					58,047

## 【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		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

(単位:百万円、%)

区 分		2020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	—	6,500	7,871	9,800	12,400	193,500	230,071
	平均受取金利	—	1.68	1.74	1.82	2.13	1.85	1.85
	平均支払金利	—	△0.02	0.06	0.04	△0.05	△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	2019年度末			2020年度第2四半期(上半期)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	4,679,142	—	△11,456	4,550,869	—	8,875
	米ドル		4,169,798	—	△34,142	3,623,477	—	24,624
	豪ドル		240,977	—	20,754	527,470	—	△7,803
	ユーロ		253,887	—	1,063	292,357	—	△8,969
	その他		14,479	—	867	107,564	—	1,023
繰延ヘッジ	通貨スワップ	外貨建 債券						
	ユーロ		35,575	35,575	538	35,575	35,575	△1,546
	豪ドル		4,305	4,305	709	4,305	4,305	80
合 計					△10,208			7,408

(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

2019年度末および2020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

2019年度末および2020年度第2四半期(上半期)末とも保有していません。