

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 | | | | | 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 | 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 | 47,124 | △235,410 | — | — | — | △188,285 |
| ヘッジ会計非適用分 | △1,320 | △32,982 | △91 | △8 | — | △34,403 |
| 合 計 | 45,803 | △268,392 | △91 | △8 | — | △222,689 |

(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年度末:通貨関連△227,340百万円)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 | 2019年度末 | | | 2020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 |
| | | | | | | | | | |
| | 金利スワップ 固定金利受取/変動金利支払 | 900 | 900 | 0 | 0 | 87,000 | 87,000 | △1,320 | △1,320 |
| | 合 計 | | | | 0 | | | | △1,320 |

(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 | — | — | — | — | — | 87,000 | 87,000 |
| | 平均受取金利 | — | — | — | — | — | 0.40 | 0.40 |
| | 平均支払金利 | — | — | — | — | — | △0.05 | △0.05 |

○通貨関連

(単位:百万円)

| 区 分 | 2019年度末 | | | | 2020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 | | | |
| 店 頭 | 為替予約 | | | | | | | | |
| | 売建 | 773,127 | — | △596 | △596 | 898,760 | — | △40,836 | △40,836 |
| | 米ドル | 687,556 | — | △4,401 | △4,401 | 821,769 | — | △38,179 | △38,179 |
| | 豪ドル | 53,582 | — | 3,472 | 3,472 | 54,482 | — | △2,721 | △2,721 |
| | ユーロ | 31,838 | — | 331 | 331 | 22,427 | — | 64 | 64 |
| | その他 | 149 | — | 0 | 0 | 80 | — | △0 | △0 |
| | 買建 | 33,772 | — | 23 | 23 | 5,775 | — | 31 | 31 |
| | 米ドル | 16,746 | — | 68 | 68 | 3,502 | — | 35 | 35 |
| | ユーロ | 11,451 | — | △83 | △83 | 1,536 | — | △2 | △2 |
| | 豪ドル | 5,523 | — | 38 | 38 | 712 | — | △2 | △2 |
| その他 | 50 | — | 0 | 0 | 24 | — | 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 | 78,660 | 78,660 | 7,315 | 7,315 | |
| 円払/米ドル受 | 7,080 | 7,080 | 881 | 881 | 8,280 | 8,280 | 507 | 507 | |
| 合 計 | | | | △19,275 | | | | △32,982 | |

(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 | 148,066 | — | △8,969 | △8,969 | 2,140 | — | △67 | △67 |
| | 買建 | 8,943 | — | 231 | 231 | 4,656 | — | 33 | 33 |
| | 外国株価指数先物 | | | | | | | | |
| | 売建 | 346 | — | △35 | △35 | 539 | — | △1 | △1 |
| | 買建 | 6,304 | — | 174 | 174 | 4,840 | — | 32 | 32 |
| 株価指数オプション | | | | | | | | | |
| 買建 | | | | | | | | | |
| プット | — | — | — | — | 99,981 | — | 214 | △88 | |
| | (-) | | | | (302) | | | | |
| 合 計 | | | | △8,598 | | | | △91 | |

(注) 1. 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。株価指数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。

○債券関連

(単位:百万円)

| 区 分 | 2019年度末 | | | | 2020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 | | | | | | | |
| 買建 | 513 | — | 9 | 9 | 803 | — | △8 | △8 |
| 合 計 | | | | 9 | | | | △8 |

(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 | 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 | 411,200 | 408,000 | 46,989 |
| 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 | 3,120 | 3,120 | 134 |
| 合 計 | | | | | 47,124 |

【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 | 6,800 | 10,420 | 7,800 | 8,300 | 377,800 | 414,320 |
| | 平均受取金利 | 1.62 | 1.75 | 1.73 | 2.03 | 2.15 | 1.05 | 1.12 |
| | 平均支払金利 | △0.05 | △0.07 | 0.09 | △0.05 | △0.05 | △0.05 | △0.05 |

○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 | 4,283,029 | — | △227,340 |
| | 米ドル | | 4,169,798 | — | △34,142 | 3,107,080 | — | △142,681 |
| | 豪ドル | | 240,977 | — | 20,754 | 796,361 | — | △67,254 |
| | ユーロ | | 253,887 | — | 1,063 | 259,122 | — | △13,256 |
| | その他 | | 14,479 | — | 867 | 120,465 | — | △4,147 |
| 繰延ヘッジ | 為替予約 売建 | 外貨建 債券 | — | — | — | 42,322 | — | △1,229 |
| | 米ドル | | — | — | — | 42,322 | — | △1,229 |
| | 通貨スワップ 米ドル | | — | — | — | 81,785 | 81,785 | △3,188 |
| | ユーロ | | 35,575 | 35,575 | 538 | 35,575 | 35,575 | △3,013 |
| | 豪ドル | | 4,305 | 4,305 | 709 | 12,404 | 12,404 | △638 |
| 合 計 | | | | △10,208 | | | △235,410 | |

(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年度末とも保有していません。