

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	2020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	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

(単位:百万円)

区 分	2021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	48,742	△52,752	—	—	—	△4,009
ヘッジ会計非適用分	—	△16,387	△72	△12	—	△16,472
合 計	48,742	△69,140	△72	△12	—	△20,481

(注) ヘッジ会計適用分のうち時価ヘッジ適用分の差損益(2020年度末:通貨関連△227,340百万円、2021年度第2四半期(上半期)末:通貨関連△44,463百万円)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	2020年度末				2021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	87,000	87,000	△1,320	△1,320	—	—	—	—
	合 計			△1,320	△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		2020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	—	—	—	—	—	87,000	87,000
	平均受取金利	—	—	—	—	—	0.40	0.40
	平均支払金利	—	—	—	—	—	△0.05	△0.05

(単位:百万円、%)

区 分		2021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	2020年度末				2021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	898,760	—	△40,836	△40,836	1,211,761	—	△21,052	△21,052	
	米ドル	821,769	—	△38,179	△38,179	1,105,764	—	△23,840	△23,840	
	豪ドル	54,482	—	△2,721	△2,721	83,415	—	2,714	2,714	
	ユーロ	22,427	—	64	64	22,481	—	73	73	
	その他	80	—	△0	△0	99	—	△0	△0	
	頭	買建	5,775	—	31	31	253,508	—	150	150
		米ドル	3,502	—	35	35	207,330	—	324	324
		豪ドル	712	—	△2	△2	28,128	—	△97	△97
		ユーロ	1,536	—	△2	△2	2,325	—	△4	△4
その他		24	—	0	0	15,723	—	△72	△72	
通貨スワップ										
円払/豪ドル受	78,660	78,660	7,315	7,315	86,020	86,020	3,348	3,348		
円払/米ドル受	8,280	8,280	507	507	25,180	25,180	1,165	1,165		
合 計				△32,982				△16,387		

(注) 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。

○株式関連

(単位:百万円)

区 分	2020年度末				2021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	2,140	—	△67	△67	2,060	—	9	9
	買建	4,656	—	33	33	4,586	—	△58	△58
	外国株価指数先物								
	売建	539	—	△1	△1	2,662	—	87	87
	買建	4,840	—	32	32	3,471	—	△110	△110
	株価指数オプション								
	買建	99,981	—	214	△88	—	—	—	—
	プット	(302)	—			(-)	—	—	—
	合 計				△91				△72

(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	2020年度末				2021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								
	買建	803	—	△8	△8	802	—	△12	△12
合 計				△8				△12	

(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	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

(単位:百万円)

ヘッジ会計の方法	種類	主なヘッジ対象	2021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	577,500	574,300	48,621
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	3,069	3,069	121
合 計					48,742

【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		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

(単位:百万円、%)

区 分		2021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	7,269	9,300	7,400	8,300	545,100	580,569
	平均受取金利	1.62	1.69	1.77	2.03	2.15	0.84	0.90
	平均支払金利	△0.06	0.02	0.02	△0.06	△0.06	△0.06	△0.06

○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	2020年度末			2021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	4,283,029	—	△227,340	4,190,629	—	△44,463
	米ドル		3,107,080	—	△142,681	2,930,801	—	△62,509
	豪ドル		796,361	—	△67,254	842,139	—	9,905
	ユーロ		259,122	—	△13,256	277,986	—	7,251
	その他		120,465	—	△4,147	139,701	—	890
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	81,785	81,785	△5,406
	ユーロ		35,575	35,575	△3,013	35,575	35,575	△2,731
	豪ドル		12,404	12,404	△638	12,404	12,404	△151
合 計				△235,410			△52,752	

(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

2020年度末および2021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

2020年度末および2021年度第2四半期(上半期)末とも保有していません。