

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	17,411	△377,845	—	—	—	△360,434
ヘッジ会計非適用分	△3,405	△86,367	282	—	—	△89,490
合 計	14,006	△464,213	282	—	—	△449,924

(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年度末:通貨関連△365,831百万円)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	116,300	116,300	△3,405	△3,405
	合 計				△1,320				△3,405

(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	—	—	—	—	—	116,300	116,300
	平均受取金利	—	—	—	—	—	0.56	0.56
	平均支払金利	—	—	—	—	—	△0.01	△0.01

○通貨関連

(単位:百万円)

区 分	2020年度末				2021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 頭	為替予約								
	売建	898,760	—	△40,836	△40,836	1,134,865	—	△82,880	△82,880
	米ドル	821,769	—	△38,179	△38,179	904,313	—	△73,420	△73,420
	豪ドル	54,482	—	△2,721	△2,721	115,613	—	△6,282	△6,282
	ユーロ	22,427	—	64	64	114,601	—	△3,178	△3,178
	その他	80	—	△0	△0	337	—	1	1
	買建	5,775	—	31	31	249,356	—	4,373	4,373
	米ドル	3,502	—	35	35	164,709	—	4,400	4,400
	豪ドル	712	—	△2	△2	49,051	—	18	18
	ユーロ	1,536	—	△2	△2	35,252	—	△45	△45
	その他	24	—	0	0	341	—	△0	△0
	通貨オプション								
	売建								
	コール	—	—	—	—	493,358	—	—	—
	米ドル	(-)	—	—	—	(907)	—	14,900	△13,993
買建									
プット	—	—	—	—	444,806	—	—	—	
米ドル	(-)	—	—	—	(907)	—	77	△830	
通貨スワップ									
円払/豪ドル受	78,660	78,660	7,315	7,315	93,320	93,320	5,170	5,170	
円払/米ドル受	8,280	8,280	507	507	38,400	38,400	1,792	1,792	
合 計				△32,982				△86,367	

(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	2020年度末				2021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	
取引所	株価指数先物								
	売建	2,140	—	△67	△67	1,580	—	△35	△35
	買建	4,656	—	33	33	4,159	—	201	201
	外国株価指数先物								
	売建	539	—	△1	△1	—	—	—	—
	買建	4,840	—	32	32	4,117	—	116	116
	株価指数オプション								
買建									
プット	99,981	—	214	△88	(-)	—	—	—	
(302)									
合 計				△91				282	

(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	—	—	—	—
合 計				△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	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	672,200	668,900	17,322
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	3,018	3,018	89
合 計					17,411

【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	3,300	7,418	9,500	7,900	9,000	638,100	675,218
	平均受取金利	1.75	1.75	1.82	2.09	2.10	0.75	0.82
	平均支払金利	0.05	0.12	0.12	0.05	0.05	△0.00	0.00

○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	4,283,029	—	△227,340	4,558,542	—	△365,831
	米ドル		3,107,080	—	△142,681	3,225,926	—	△237,894
	豪ドル		796,361	—	△67,254	1,033,020	—	△115,185
	ユーロ		259,122	—	△13,256	213,676	—	△6,309
	その他		120,465	—	△4,147	85,918	—	△6,441
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	76,594	△8,811
	ユーロ		35,575	35,575	△3,013	35,575	35,575	△2,543
	豪ドル		12,404	12,404	△638	12,404	12,404	△658
合 計				△235,410			△377,845	

(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年度末とも保有していません。