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	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

(単位:百万円)

区分	2022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	△33,920	△554,601	—	—	—	△588,521
ヘッジ会計非適用分	△288	17,244	△578	—	—	16,376
合計	△34,209	△537,356	△578	—	—	△572,144

(注) ヘッジ会計適用分のうち時価ヘッジ適用分の差損益(2021年度末:通貨関連△365,831百万円、2022年度第2四半期(上半期)末:通貨関連△533,789百万円)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		2021年度末				2022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		
店頭	金利スワップ 固定金利受取/変動金利支払	116,300	116,300	△3,405	△3,405	47,700	47,700	△288	△288
合計					△3,405				△288

(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		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

(単位:百万円、%)

区分		2022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	—	—	3,500	—	—	44,200	47,700
	平均受取金利	—	—	1.93	—	—	0.91	0.99
	平均支払金利	—	—	0.01	—	—	△0.06	△0.05

○通貨関連

（単位：百万円）

区　分		2021年度末				2022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	1,134,865	—	△82,880	△82,880	369,450	—	△42,542	△42,542
	米ドル	904,313	—	△73,420	△73,420	325,324	—	△42,901	△42,901
	豪ドル	115,613	—	△6,282	△6,282	43,745	—	358	358
	ユーロ	114,601	—	△3,178	△3,178	209	—	1	1
	その他	337	—	1	1	170	—	△0	△0
	買建	249,356	—	4,373	4,373	861,730	—	59,895	59,895
	米ドル	164,709	—	4,400	4,400	827,401	—	59,951	59,951
	豪ドル	49,051	—	18	18	32,683	—	△54	△54
	ユーロ	35,252	—	△45	△45	1,645	—	△1	△1
	その他	341	—	△0	△0	—	—	—	—
	通貨オプション								
	売建								
	コール	493,358	—			121,050	—		
		(907)		14,900	△13,993	(1,261)		3,070	△1,809
	米ドル	493,358	—			121,050	—		
		(907)		14,900	△13,993	(1,261)		3,070	△1,809
	買建								
	プット	444,806	—			113,370	—		
		(907)		77	△830	(1,261)		467	△794
	米ドル	444,806	—			113,370	—		
		(907)		77	△830	(1,261)		467	△794
	通貨スワップ								
	円払／豪ドル受	93,320	93,320	5,170	5,170	117,470	117,470	△1,200	△1,200
	円払／米ドル受	38,400	38,400	1,792	1,792	54,920	54,920	3,695	3,695
合　計					△86,367				17,244

（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		2021年度末				2022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	1,580	—	△35	△35	1,097	—	69	69
	買建	4,159	—	201	201	4,506	—	△155	△155
	外国株価指数先物								
	売建	—	—	—	—	115	—	13	13
	買建	4,117	—	116	116	6,095	—	△506	△506
合　計					282				△578

（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

2021年度末および2022年度第2四半期（上半期）末とも保有していません。

(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	2021年度末		
			契約額等	うち1年超	時価
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

(単位:百万円)

ヘッジ会計の方法	種類	主なヘッジ対象	2022年度第2四半期(上半期)末		
			契約額等	うち1年超	時価
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	806,100	806,100	△33,988
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	2,967	2,967	68
合　　計					△33,920

【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		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	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

(単位:百万円、%)

区　　分		2022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	—	7,367	6,000	7,500	17,300	770,900	809,067
	平均受取金利	—	1.75	1.75	2.09	2.01	0.71	0.77
	平均支払金利	—	0.10	0.13	△0.01	0.03	0.01	0.01

○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	2021年度末			2022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	4,558,542	—	△365,831	5,080,719	—	△533,789
	米ドル		3,225,926	—	△237,894	3,840,673	—	△475,018
	豪ドル		1,033,020	—	△115,185	922,723	—	△49,085
	ユーロ		213,676	—	△6,309	279,162	—	△6,879
	その他		85,918	—	△6,441	38,160	—	△2,807
繰延ヘッジ	通貨スワップ							
	米ドル	外貨建債券	81,785	76,594	△8,811	81,785	76,594	△19,843
	ユーロ		35,575	35,575	△2,543	35,575	35,575	△817
	豪ドル		12,404	12,404	△658	12,404	12,404	△149
合　　計					△377,845			△554,601

（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

2021年度末および2022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

2021年度末および2022年度第2四半期（上半期）末とも保有していません。