

デリバティブ取引情報

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引について、取引の対象物の種類ごとの決算日における契約額又は契約において定められた元本相当額、時価及び評価損益並びに当該時価の算定方法は、次のとおりであります。なお、契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

●金利関連取引

(単位：百万円)

区分	種 類		2021年3月31日				2022年3月31日			
			契約額等		時価	評価損益	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超				うち1年超			
金融商品取引所	金利先物	売建	-	-	-	-	-	-	-	-
		買建	-	-	-	-	-	-	-	-
	金利オプション	売建	-	-	-	-	-	-	-	-
		買建	-	-	-	-	-	-	-	-
店頭	金利先渡契約	売建	-	-	-	-	-	-	-	-
		買建	-	-	-	-	-	-	-	-
	金利スワップ	受取固定・支払変動	19,653	18,921	572	572	18,116	17,632	394	394
		受取変動・支払固定	19,653	18,921	△341	△341	18,148	17,663	△195	△195
		受取変動・支払変動	-	-	-	-	-	-	-	-
	金利オプション	売建	-	-	-	-	-	-	-	-
		買建	-	-	-	-	-	-	-	-
	その他	売建	-	-	-	-	-	-	-	-
買建		-	-	-	-	-	-	-	-	
合 計				230	230			199	199	

(注) 上記取引については時価評価を行い、評価損益を損益計算書に計上しております。

●通貨関連取引

(単位：百万円)

区分	種 類		2021年3月31日				2022年3月31日			
			契約額等		時価	評価損益	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超				うち1年超			
金融商品取引所	通貨先物	売建	-	-	-	-	-	-	-	-
		買建	-	-	-	-	-	-	-	-
	通貨オプション	売建	-	-	-	-	-	-	-	-
		買建	-	-	-	-	-	-	-	-
店頭	通貨スワップ		5,535	5,535	△177	△177	6,119	-	△744	△744
	為替予約	売建	71,394	749	△2,112	△2,112	51,093	1,064	△2,422	△2,422
		買建	51,475	586	1,933	1,933	56,284	924	2,672	2,672
	通貨オプション	売建	49,506	13,827	△936	△48	34,257	5,797	△954	△398
		買建	49,506	13,827	936	287	34,257	5,797	954	632
	その他	売建	-	-	-	-	-	-	-	-
買建		-	-	-	-	-	-	-	-	
合 計				△355	△116			△494	△260	

(注) 上記取引については時価評価を行い、評価損益を損益計算書に計上しております。

- 株式関連取引 該当ありません。 ●債券関連取引 該当ありません。 ●商品関連取引 該当ありません。 ●クレジット・デリバティブ取引 該当ありません。

●その他

(単位：百万円)

区分	種 類		2021年3月31日			2022年3月31日		
			契約額等	時価	評価損益	契約額等	時価	評価損益
店 頭	地震 デリバティブ	売建	8,560	-	△95	15,770	-	△156
		買建	8,560	-	95	15,770	-	156
	天候 デリバティブ	売建	200	-	△4	1,750	-	△20
		買建	200	-	4	1,750	-	20
合 計								

(注) 上記取引については時価評価を行い、評価損益を損益計算書に計上しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引について、取引の対象物の種類ごと、ヘッジ会計の方法別の決算日における契約額又は契約において定められた元本相当額及び時価並びに当該時価の算定方法は、次のとおりであります。なお、契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

●金利関連取引

(単位：百万円)

ヘッジ会計の方法	種 類		主なヘッジ対象	2021年3月31日			2022年3月31日		
				契約額等	時価	評価損益	契約額等	時価	評価損益
原則的処理 方法	金利 スワップ	受取固定・支払変動	貸出金等の有利息の金融資産	-	-	-	-	-	-
		受取変動・支払固定		113,312	93,312	△11,422	35,854	35,854	△388
	金利先物	-		-	-	-	-	-	
	金利オプション	-		-	-	-	-	-	
金利スワップの 特例処理	金利 スワップ	受取固定・支払変動	-	-	-	-	-	-	
		受取変動・支払固定	-	-	-	-	-	-	
	合 計				△11,422			△388	

(注) ヘッジ対象とヘッジ手段を紐付けする方法のほか、「銀行業における金融商品会計基準適用に関する会計上及び監査上の取扱い」(日本公認会計士協会業種別委員会実務指針第24号 2022年3月17日)に基づき、繰延ヘッジによっております。

●通貨関連取引

(単位：百万円)

ヘッジ会計の方法	種 類		主なヘッジ対象	2021年3月31日			2022年3月31日		
				契約額等	時価	評価損益	契約額等	時価	評価損益
原則的処理 方法	通貨スワップ		外貨建の有価証券等	31,955	15,348	△1,471	28,634	4,156	△3,500
	為替予約			-	-	-	-	-	-
	その他			-	-	-	-	-	-
為替予約等の 振当処理	通貨スワップ		-	-	-	-	-	-	
	為替予約		-	-	-	-	-	-	
	合 計				△1,471			△3,500	

(注) 主として「銀行業における外貨建取引等の会計処理に関する会計上及び監査上の取扱い」(日本公認会計士協会業種別委員会実務指針第25号 2020年10月8日)に基づき、繰延ヘッジによっております。

- 株式関連取引 該当ありません。 ●債券関連取引 該当ありません。