# 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中間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 | | 2019年9月30日 | | | | 2020年9月30日 | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | 契約額等 | うち1年超 | 時価 | 評価損益 | 契約額等 | うち1年超 | 時価 | 評価損益 |
| 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 | 30,403 | 23,005 | 733 | 773 | 22,513 | 19,677 | 680 | 680 |
| | | 受取変動・支払固定 | 30,403 | 23,005 | △451 | △451 | 22,513 | 19,677 | △424 | △424 |
| | | 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 | | | | | 281 | 281 | | | 255 | 255 |

（注）1. 上記取引については時価評価を行い、評価損益を中間損益計算書に計上しております。
2. 時価の算定
店頭取引については、割引現在価値やオプション価格計算モデル等により算定しております。

### ●通貨関連取引

（単位：百万円）

| 区分 | 種類 | | 2019年9月30日 | | | | 2020年9月30日 | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | 契約額等 | うち1年超 | 時価 | 評価損益 | 契約額等 | うち1年超 | 時価 | 評価損益 |
| 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 | | - | - | - | - | 5,290 | 5,290 | 67 | 67 |
| | 為替予約 | 売建 | 28,925 | 1,623 | △311 | △311 | 50,172 | 932 | △513 | △513 |
| | | 買建 | 32,151 | 1,392 | 376 | 376 | 59,669 | 774 | 675 | 675 |
| | 通貨オプション | 売建 | 36,335 | 10,943 | △703 | 180 | 44,146 | 13,096 | △708 | 235 |
| | | 買建 | 36,335 | 10,943 | 703 | 48 | 44,146 | 13,096 | 708 | 2 |
| | その他 | 売建 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| | | 買建 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 合計 | | | | | 64 | 293 | | | 230 | 468 |

（注）1. 上記取引については時価評価を行い、評価損益を中間損益計算書に計上しております。
2. 時価の算定
割引現在価値等により算定しております。

## ●株式関連取引

（単位：百万円）

| 区分 | 種類 | | 2019年9月30日 | | | | 2020年9月30日 | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | 契約額等 | うち1年超 | 時価 | 評価損益 | 契約額等 | うち1年超 | 時価 | 評価損益 |
| 金融商品取引所 | 株式指数先物 | 売建 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| | | 買建 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| | 株式指数オプション | 売建 | 7,983 | - | △84 | 1 | 5,021 | - | △73 | 14 |
| | | 買建 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 店頭 | 有価証券店頭オプション | 売建 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| | | 買建 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| | 有価証券店頭指数等スワップ | 株価指数変化率受取・短期変動金利支払 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| | | 短期変動金利受取・株価指数変化率支払 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| | その他 | 売建 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| | | 買建 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 合計 | | | | | △84 | 1 | | | △73 | 14 |

（注）1. 上記取引については時価評価を行い、評価損益を中間損益計算書に計上しております。
2. 時価の算定
取引所取引については、大阪取引所等における最終の価格によっております。

## ●債券関連取引

（単位：百万円）

| 区分 | 種類 | | 2019年9月30日 | | | | 2020年9月30日 | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | 契約額等 | うち1年超 | 時価 | 評価損益 | 契約額等 | うち1年超 | 時価 | 評価損益 |
| 金融商品取引所 | 債券先物 | 売建 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| | | 買建 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| | 債券先物オプション | 売建 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| | | 買建 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 店頭 | 債券店頭オプション | 売建 | 5,000 | - | △19 | 20 | 3,000 | - | △14 | 0 |
| | | 買建 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| | その他 | 売建 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| | | 買建 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 合計 | | | | | △19 | 20 | | | △14 | 0 |

（注）1. 上記取引については時価評価を行い、評価損益を中間損益計算書に計上しております。
2. 時価の算定
店頭取引については、オプション価格計算モデル等により算定しております。

## ●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 | | 2019年9月30日 | | | | 2020年9月30日 | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | 契約額等 | うち1年超 | 時価 | 評価損益 | 契約額等 | うち1年超 | 時価 | 評価損益 |
| 店頭 | 地震デリバティブ | 売建 | 1,750 | - | △23 | - | 8,010 | - | △57 | - |
| | | 買建 | 1,750 | - | 23 | - | 8,010 | - | 57 | - |
| 合計 | | | | | - | - | | | - | - |

（注）時価については、契約期間、その他当該取引に係る契約を構成する要素を勘案し、当該帳簿価額を記載しております。

## 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中間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 | 2019年9月30日 契約額等 | うち1年超 | 時価 | 2020年9月30日 契約額等 | うち1年超 | 時価 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 原則的処理方法 | 金利スワップ | 受取固定・支払変動 | 貸出金、その他有価証券（債券）の有利息の金融資産 | - | - | - | - | - | - |
| | | 受取変動・支払固定 | | 133,784 | 113,699 | △17,814 | 121,776 | 111,776 | △26,636 |
| | 金利先物 | | | - | - | - | - | - | - |
| | 金利オプション | | | - | - | - | - | - | - |
| | その他 | | | - | - | - | - | - | - |
| 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 | | | | | △17,814 | | | △26,636 |

（注）1. 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監査委員会報告第24号　2002年2月13日）に基づき、繰延ヘッジ（キャッシュ・フローを固定するヘッジ）によっております。
2. 時価の算定
取引所取引については、東京金融取引所等における最終の価格によっております。店頭取引については、割引現在価値やオプション価格計算モデル等により算定しております。

### ●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 | 2019年9月30日 契約額等 | うち1年超 | 時価 | 2020年9月30日 契約額等 | うち1年超 | 時価 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 原則的処理方法 | 通貨スワップ | 外貨建の有価証券等 | 30,798 | 10,294 | 456 | 30,780 | 14,910 | 325 |
| | 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 | | | | 456 | | | 325 |

（注）1. 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監査委員会報告第25号　2002年7月29日）に基づき、繰延ヘッジによっております。
2. 時価の算定
割引現在価値等により算定しております。

### ●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。