

## 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		2022年3月31日				2023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	18,116	17,632	394	394	17,547	16,786	243	243
		受取変動・支払固定	18,148	17,663	△195	△195	17,547	16,786	△66	△66
		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				199	199			176	176	

(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		2022年3月31日				2023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		6,119	-	△744	△744	-	-	-	-
	為替予約	売建	51,093	1,064	△2,422	△2,422	48,122	1,215	△923	△923
		買建	56,284	924	2,672	2,672	47,555	1,128	999	999
	通貨オプション	売建	34,257	5,797	△954	△398	76,877	36,425	△2,347	47
		買建	34,257	5,797	954	632	76,877	36,425	2,347	444
	その他	売建	-	-	-	-	-	-	-	-
買建		-	-	-	-	-	-	-	-	
合 計				△494	△260			75	567	

(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		2022年3月31日			2023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
店 頭	地震 デリバティブ	売建	15,770	-	△156	-	20,220	-	△187	-
		買建	15,770	-	156	-	20,220	-	187	-
	天候 デリバティブ	売建	1,750	-	△20	-	1,830	-	△21	-
		買建	1,750	-	20	-	1,830	-	21	-
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	2022年3月31日			2023年3月31日		
				契約額等	時価	契約額等	時価		
								うち1年超	うち1年超
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		35,854	35,854	△388	33,761	33,637	519
	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				△388			519	

(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	2022年3月31日			2023年3月31日		
				契約額等	時価	契約額等	時価		
								うち1年超	うち1年超
原則的処理 方法	通貨スワップ		外貨建の有価証券等	28,634	4,156	△3,500	29,141	3,891	△406
	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				△3,500			△406	

(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。

暗号資産

該当ありません。