

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		2021年9月30日				2022年9月30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	18,495	18,088	559	559	17,680	17,067	277	277
		受取変動・支払固定	18,495	18,088	△343	△343	17,680	17,067	△87	△87
		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				216	216			190	190	

(注) 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。

●通貨関連取引

(単位：百万円)

区分	種 類		2021年9月30日				2022年9月30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		5,596	-	△226	△226	-	-	-	-
	為替予約	売建	56,165	1,023	△285	△285	59,312	1,252	△2,734	△2,734
		買建	52,770	871	442	442	61,607	1,078	2,780	2,780
	通貨オプション	売建	57,546	18,723	△690	344	57,880	22,760	△952	535
		買建	57,546	18,723	690	△43	57,880	22,760	952	△243
	その他	売建	-	-	-	-	-	-	-	-
買建		-	-	-	-	-	-	-	-	
合 計				△69	231			46	338	

(注) 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。

●債券関連取引

(単位：百万円)

区分	種 類		2021年9月30日				2022年9月30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	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	-	△1	13	10,000	-	△11	5
		買建	-	-	-	-	-	-	-	-
	その他	売建	-	-	-	-	-	-	-	-
		買建	-	-	-	-	-	-	-	-
合 計				△1	13			△11	5	

(注) 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。

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

●その他

(単位：百万円)

区分	種類		2021年9月30日			2022年9月30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	11,960	-	△100	-	18,700	-	△152	-
		買建	11,960	-	100	-	18,700	-	152	-
	天候 デリバティブ	売建	1,400	-	△25	-	1,780	-	△28	-
		買建	1,400	-	25	-	1,780	-	28	-
合計										

(注) 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. 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	2021年9月30日			2022年9月30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	貸出金等の有利利息の金融資産	-	-	-	-	-	-
		受取変動・支払固定		112,759	92,759	△15,865	34,883	34,883	346
	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				△15,865			346	

(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9月30日			2022年9月30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	32,045	4,065	△1,682	26,293	4,572	△4,095
	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				△1,682			△4,095	

(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 2022年3月17日)に基づき、繰延ヘッジによっております。

- 株式関連取引 ●債券関連取引
 該当ありません。 該当ありません。