

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。

(1) 金利関連取引

該当する取引はありません。

(2) 通貨関連取引

(単位：百万円)

区分	種類	2019年度中間期末				2020年度中間期末				
		契約額等	契約額等のうち 1年超のもの	時価	評価損益	契約額等	契約額等のうち 1年超のもの	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		—	—	—	—	—	—	—	
	為替予約	売建	32,797	—	△ 161	△ 161	23,740	—	3	3
		買建	1,218	—	1	1	444	—	0	0
	通貨オプション	売建	15,488	8,347	△ 421	353	20,929	9,155	△ 417	417
		買建	15,488	8,347	418	△ 277	20,929	9,155	398	△ 296
	その他	売建	—	—	—	—	—	—	—	—
買建		—	—	—	—	—	—	—	—	
合計		—	—	△ 162	△ 83	—	—	△ 15	124	

(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。

(3) 株式関連取引

該当する取引はありません。

(4) 債券関連取引

該当する取引はありません。

(5) 商品関連取引

該当する取引はありません。

(6) クレジットデリバティブ取引

該当する取引はありません。

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。

(1) 金利関連取引

(単位：百万円)

ヘッジ会計の方法	種類	2019年度中間期末				2020年度中間期末			
		主なヘッジ対象	契約額等	契約額等のうち1年超のもの	時価	主なヘッジ対象	契約額等	契約額等のうち1年超のもの	時価
原則的 処理方法	金利 スワップ	受取固定・支払変動	—	—	—	—	—	—	—
		受取変動・支払固定	—	—	—	—	—	—	—
	金利 オプション	売 建	—	—	—	—	—	—	—
		買 建	—	—	—	—	—	—	—
	その他	売 建	—	—	—	—	—	—	—
		買 建	—	—	—	—	—	—	—
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	貸出金	—	—	—	貸出金	—	—
		受取変動・支払固定	—	7,835	7,013	△ 604	—	7,013	6,191
合計		—	—	—	△ 604	—	—	—	△ 464

(注) 時価の算定
店頭取引については、割引現在価値等により算定しております。

(2) 通貨関連取引

該当する取引はありません。

(3) 株式関連取引

該当する取引はありません。

(4) 債券関連取引

該当する取引はありません。