

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。

(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 | 2017年度末 | | | | 2018年度末 | | | | |
|---------------------|---------|---------|-------------------|-------|-------|---------|-------------------|-------|-------|-------|
| | | 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 | 462 | — | 3 | 3 | — | — | — | — | |
| | 為替予約 | 売建 | 35,877 | 113 | 828 | 828 | 36,834 | — | △ 198 | △ 198 |
| | | 買建 | 3,102 | — | △ 23 | △ 23 | 5,136 | — | 26 | 26 |
| | 通貨オプション | 売建 | 12,816 | 6,498 | △ 497 | 98 | 13,565 | 7,471 | △ 427 | 334 |
| | | 買建 | 12,816 | 6,498 | 497 | △ 31 | 13,565 | 7,471 | 427 | △ 264 |
| | その他 | 売建 | — | — | — | — | — | — | — | — |
| 買建 | | — | — | — | — | — | — | — | — | |
| 合計 | | — | — | 809 | 876 | — | — | △ 171 | △ 101 | |

(注) 1. 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. 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 | | 2017年度末 | | | | 2018年度末 | | | |
|-----------------|-------------|-----------|---------|-------|---------------|-------|---------|-------|---------------|-------|
| | | | 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 | — | 9,068 | 8,246 | △ 644 | — | 8,246 | 7,424 | △ 614 |
| 合計 | | | — | — | — | △ 644 | — | — | — | △ 614 |

(注) 時価の算定
店頭取引につきましては、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。