

# 金銭の信託関係／その他有価証券評価差額金／デリバティブ情報

## 金銭の信託関係

### 1.運用目的の金銭の信託

(単位：百万円)

|            |                | 2019年3月31日 | 2020年3月31日 |
|------------|----------------|------------|------------|
| 運用目的の金銭の信託 | 貸借対照表計上額       | 1,490      | 1,494      |
|            | 当期の損益に含まれた評価差額 | △9         | △5         |

### 2.満期保有目的の金銭の信託

該当事項はありません。

### 3.その他の金銭の信託（運用目的及び満期保有目的以外）

該当事項はありません。

## その他有価証券評価差額金

貸借対照表に計上されているその他有価証券評価差額金の内訳は、次のとおりであります。

(単位：百万円)

|              | 2019年3月31日 | 2020年3月31日 |
|--------------|------------|------------|
| 評価差額         | 25,722     | 14,628     |
| その他有価証券      | 25,722     | 14,628     |
| その他の金銭の信託    | —          | —          |
| (△)繰延税金負債    | 7,639      | 4,405      |
| その他有価証券評価差額金 | 18,082     | 10,223     |

## デリバティブ情報

### 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。

#### (1) 金利関連取引

(単位：百万円)

| 区分      | 種類        | 2019年3月31日 |       |    |      | 2020年3月31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      | —          | —     | —  | —    | —          | —     | —  | —    |
|         | 金利オプション   | —          | —     | —  | —    | —          | —     | —  | —    |
| 店頭      | 金利先渡契約    | —          | —     | —  | —    | —          | —     | —  | —    |
|         | 金利スワップ    | —          | —     | —  | —    | —          | —     | —  | —    |
|         | 受取固定・支払変動 | —          | —     | —  | —    | —          | —     | —  | —    |
|         | 受取変動・支払固定 | 438        | 115   | △3 | △3   | 143        | 143   | △4 | △4   |
|         | 受取変動・支払変動 | —          | —     | —  | —    | —          | —     | —  | —    |
|         | 金利オプション   | —          | —     | —  | —    | —          | —     | —  | —    |
| その他     | —         | —          | —     | —  | —    | —          | —     | —  |      |
| 合計      | —         | —          | △3    | △3 | —    | —          | △4    | △4 |      |

(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

店頭取引につきましては、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。

#### (2) 通貨関連取引

(単位：百万円)

| 区分      | 種類      | 2019年3月31日 |       |      |      | 2020年3月31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    | —          | —     | —    | —    | —          | —     | —    | —    |
|         | 通貨オプション | —          | —     | —    | —    | —          | —     | —    | —    |
| 店頭      | 通貨スワップ  | 48,722     | —     | △231 | △231 | 45,123     | —     | △171 | △171 |
|         | 為替予約    | —          | —     | —    | —    | —          | —     | —    | —    |
|         | 売建      | 1,688      | 174   | △10  | △10  | 1,705      | 112   | △1   | △1   |
|         | 買建      | 1,461      | 172   | 17   | 17   | 1,589      | 111   | 6    | 6    |
|         | 通貨オプション | —          | —     | —    | —    | —          | —     | —    | —    |
| その他     | —       | —          | —     | —    | —    | —          | —     | —    |      |
| 合計      | —       | —          | △224  | △224 | —    | —          | △166  | △166 |      |

(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。

連結情報

単体情報