

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)

運用目的の金銭の信託	貸借対照表計上額 当期の損益に含まれた評価差額	2021年3月31日	2022年3月31日
		1,494	1,491
		△5	△8

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)

	2021年3月31日	2022年3月31日
評価差額	20,782	14,020
その他有価証券	20,782	14,020
その他の金銭の信託	—	—
(△)繰延税金負債	6,170	4,140
その他有価証券評価差額金	14,611	9,880

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	2021年3月31日				2022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	—	—	—	—	4,639	4,639	83	83
	受取変動・支払固定	143	124	△0	△0	9,167	9,167	△79	△79
	受取変動・支払変動	—	—	—	—	3,409	3,409	29	29
	金利オプション	—	—	—	—	—	—	—	—
	その他	—	—	—	—	—	—	—	—
合 計		—	—	△0	△0	—	—	33	33

(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	2021年3月31日				2022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	50,218	—	△2,083	△2,083	43,953	—	△2,623	△2,623
	為替予約	—	—	—	—	—	—	—	—
	売 建	1,291	51	△46	△46	1,395	—	△89	△89
	買 建	1,532	50	39	39	1,467	—	86	86
	通貨オプション	—	—	—	—	—	—	—	—
	その他	—	—	—	—	—	—	—	—
合 計		—	—	△2,091	△2,091	—	—	△2,626	△2,626

(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。

単体及び連結決算の
状況営業の概況

連結情報

単体情報

デリバティブ情報

(3) 株式関連取引、(4) 債券関連取引、(5) 商品関連取引及び(6) クレジット・デリバティブ取引については該当事項はありません。

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	2021年3月31日				2022年3月31日			
		主 なる ヘッジ対象	契約額等	うち1年超	時価	主 なる ヘッジ対象	契約額等	うち1年超	時価
原則的処理方法	金 利 ス ワ ッ プ	貸出金 その他の有価証券 (債券)				貸出金、 その他の有価証券 (債券)			
	受取固定・支払変動		—	—	—		—	—	—
	受取変動・支払固定		64,060	63,113	△447		147,957	127,931	178
金利スワップの特例処理	金 利 ス ワ ッ プ	貸出金				貸出金			
	受取固定・支払変動		—	—	—		—	—	—
	受取変動・支払固定		401	401	△6		160	—	△1
合 計		—	—	—	△454	—	—	—	177

(注) 1. 主として業種別委員会実務指針第24号に基づき、繰延ヘッジによっております。

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、(3) 株式関連取引及び(4) 債券関連取引については該当事項はありません。