

# デリバティブ情報

## 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	2022年9月30日				2023年9月30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	7,540	7,540	17	17	23,922	23,910	△82	△82
	受取変動・支払固定	17,211	17,211	117	117	33,950	33,938	449	449
	受取変動・支払変動	10,017	10,017	62	62	9,610	9,610	9	9
	金利オプション	—	—	—	—	—	—	—	—
その他	—	—	—	—	—	—	—	—	
合計	合計	—	—	198	198	—	—	376	376

(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) 通貨関連取引

(単位：百万円)

区分	種類	2022年9月30日				2023年9月30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	20,748	—	△358	△358	59,539	—	△2,427	△2,427
	為替予約	—	—	—	—	—	—	—	—
	売建	1,129	—	△47	△47	1,449	—	△79	△79
	買建	1,006	—	54	54	922	—	77	77
	通貨オプション	—	—	—	—	—	—	—	—
その他	—	—	—	—	—	—	—	—	
合計	合計	—	—	△351	△351	—	—	△2,430	△2,430

(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。

(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	主 な ヘッジ対象	2022年9月30日			2023年9月30日		
			契約額等	うち1年超	時価	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	—	—	—	貸出金	—	—
	受取固定・支払変動	その他有価証券	—	—	—	その他有価証券	—	—
	受取変動・支払固定	(債券)	182,896	182,892	3,639	92,244	92,244	3,555
金利スワップの特例処理	金利スワップ	貸出金	—	—	—	—	—	—
	受取固定・支払変動	—	—	—	—	—	—	—
	受取変動・支払固定	—	39	—	△0	—	—	—
合計	合計	—	—	—	3,639	—	—	3,555

(注) 1. 主として「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」(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. 金利スワップの特例処理によるものは、ヘッジ対象とされている貸出金と一体として処理されているため、その時価は「連結情報 注記事項(金融商品関係)」の当該貸出金の時価に含めて記載しております。

(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。