

Note 30 - Finansielle derivater

Alle derivater blir bokført til virkelig verdi over resultatet. Urealiserte gevinster blir ført som eiendeler og urealiserte tap ført som gjeld. Dette gjelder både derivater benyttet til sikringsformål og holdt for handelsformål. Banken benytter seg ikke av kontantstrømsikring.

Kontraktssum viser absoluttverdier for alle kontrakter.

For beskrivelse av motpartsrisiko og markedsrisiko se beskrivelse i note 6 Risikoforhold. Ytterligere detaljer vedrørende markedsrisiko knyttet til renterisiko se note 16, og for markedsrisiko knyttet til valutaeksponering se note 17.

Morbank

Til virkelig verdi over resultatet (mill. kr)	31.12.17			31.12.16		
	Kontraktssum	Virkelig verdi		Kontraktssum	Virkelig verdi	
		Eiendeler	Forpliktelser		Eiendeler	Forpliktelser
Valutainstrumenter						
Valutaterminer (forwards)	3.661	86	-51	3.176	21	0
Valutabytteavtaler (swap)	11.654	321	-70	15.100	163	-5
Valutaopsjoner	59	0	-0	36	0	-0
Sum valutainstrumenter	15.375	407	-122	18.312	184	-5
Renteinstrumenter						
Rentebytteavtaler (inkl. rente- og valutaswap, dekker også cross currency)	178.023	2.532	-2.463	170.417	3.213	-3.282
Korte rentebytteavtaler (FRA)	9.000	2	-1	50.423	101	-110
Andre rentekontrakter	-	-	-	124	-0	0
Sum renteinstrumenter	187.023	2.534	-2.464	220.964	3.314	-3.393
Varerelaterte kontrakter						
Børsomsatte standardiserte forwards- og futures- kontrakter	246	60	-60	109	14	-14
Sum varerelaterte kontrakter	246	60	-60	109	14	-14
Benyttet til sikringsformål						
Renteinstrumenter						
Rentebytteavtaler (inkl. rente- og valutaswap, dekker også cross currency)	33.623	780	-230	25.249	807	-127
Sum renteinstrumenter	33.623	780	-230	25.249	807	-127
Sum						
Sum renteinstrumenter	220.645	3.314	-2.693	246.213	4.121	-3.520
Sum valutainstrumenter	15.375	407	-122	18.312	184	-5
Sum varerelaterte kontrakter	246	60	-60	109	14	-14
Påløpte renter		548	-466		493	-434
Sum finansielle derivater	236.266	4.328	-3.341	264.634	4.812	-3.973

Konsern

Til virkelig verdi over resultatet (mill. kr)	31.12.17			31.12.16		
	Kontraktssum	Virkelig verdi		Kontraktssum	Virkelig verdi	
		Eiendeler	Forpliktelser		Eiendeler	Forpliktelser
Valutainstrumenter						
Valutaterminer (forwards)	3.661	86	-51	3.176	21	0
Valutabytteavtaler (swap)	11.654	321	-70	15.100	163	-5
Valutaopsjoner	59	0	-0	36	0	-0
Sum valutainstrumenter	15.375	407	-122	18.312	184	-5
Renteinstrumenter						
Rentebytteavtaler (inkl. rente- og valutaswap, dekker også cross currency)	178.023	2.532	-2.463	170.094	3.137	-3.282
Korte rentebytteavtaler (FRA)	9.000	2	-1	50.423	101	-110
Andre rentekontrakter	-	-	-	124	-0	0
Sum renteinstrumenter	187.023	2.534	-2.464	220.640	3.239	-3.393
Egenkapitalinstrumenter						
Aksjeopsjoner	37	12	-13	32	17	-14
Aksjeterminer/futures	1.535	10	11	909	1	-87
Sum egenkapitalinstrumenter	1.573	23	-2	940	18	-101
Varerelaterte kontrakter						
Børsomsatte standardiserte forwards- og futures- kontrakter	246	60	-60	109	14	-14
Sum varerelaterte kontrakter	246	60	-60	109	14	-14
Benyttet til sikringsformål						
Renteinstrumenter						
Rentebytteavtaler (inkl. rente- og valutaswap, dekker også cross currency)	33.623	780	-230	25.249	807	-127
Sum renteinstrumenter	33.623	780	-230	25.249	807	-127
Sum						
Sum renteinstrumenter	220.645	3.314	-2.693	245.890	4.046	-3.520
Sum valutainstrumenter	15.375	407	-122	18.312	184	-5
Sum egenkapitalinstrumenter	1.573	23	-2	940	18	-101
Sum varerelaterte kontrakter	246	60	-60	109	14	-14
Påløpte renter		548	-466		490	-434
Sum finansielle derivater	237.839	4.351	-3.343	265.251	4.752	-4.074