

Note 28 - Finansielle derivater

Alle derivater blir bokført til virkelig verdi over resultatet. Gevinster blir ført som eiendeler og tap ført som gjeld for alle rentederivater. 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 14, og for markedsrisiko knyttet til valutaeksponering se note 15.

Morbank

Til virkelig verdi over resultatet (mill. kr)	31.12.21			31.12.20		
	Kontraktssum	Virkelig verdi		Kontraktssum	Virkelig verdi	
		Eiendeler	Forpliktelser		Eiendeler	Forpliktelser
Valutainstrumenter						
Valutaterminer (forwards)	6.834	98	-79	4.947	72	-143
Valutabytteavtaler (swap)	10.027	205	-154	9.376	295	-51
Valutaopsjoner	58	1	-1	132	1	-2
Sum valutainstrumenter	16.919	304	-235	14.455	368	-196
Renteinstrumenter						
Rentebytteavtaler (inkl. cross currency interest rate swap)	252.753	1.776	-1.866	249.493	4.924	-5.535
Korte rentebytteavtaler (FRA)	-	-	-	2.000	7	-7
Sum renteinstrumenter	252.753	1.776	-1.866	251.493	4.931	-5.542
Varerelaterte kontrakter						
Børsomsatte standardiserte forwards og futures kontrakter	814	190	-190	1.549	83	-83
Sum varerelaterte kontrakter	814	190	-190	1.549	83	-83
Sikring						
Renteinstrumenter						
Rentebytteavtaler (inkl. cross currency interest rate swap)	36.895	353	-511	37.771	921	-48
Sum renteinstrumenter	36.895	353	-511	37.771	921	-48
Sum						
Sum renteinstrumenter	289.649	2.129	-2.376	289.265	5.852	-5.590
Sum valutainstrumenter	16.919	304	-235	14.455	368	-196
Sum varerelaterte kontrakter	814	190	-190	1.549	83	-83
Påløpte renter		569	-699		872	-977
Sum finansielle derivater	307.382	3.192	-3.500	305.269	7.175	-6.845

Konsern

Til virkelig verdi over resultatet (mill. kr)	31.12.21			31.12.20		
	Kontraktssum	Virkelig verdi		Kontraktssum	Virkelig verdi	
Valutainstrumenter		Eiendeler	Forpliktelser		Eiendeler	Forpliktelser
Valutaterminer (forwards)	6.834	98	-79	4.947	72	-143
Valutabytteavtaler (swap)	10.027	205	-154	9.376	295	-51
Valutaopsjoner	58	1	-1	132	1	-2
Sum valutainstrumenter	16.919	304	-235	14.455	368	-196
Renteinstrumenter						
Rentebytteavtaler (inkl. cross currency interest rate swap)	252.753	1.776	-1.866	249.493	4.924	-5.535
Korte rentebytteavtaler (FRA)	-	-	-	2.000	7	-7
Sum renteinstrumenter	252.753	1.776	-1.866	251.493	4.931	-5.542
Egenkapitalinstrumenter						
Aksjeopsjoner	69	32	-25	21	9	-12
Aksjeterminer/futures	1.329	0	-384	1.393	42	-322
Sum egenkapitalinstrumenter	1.397	33	-409	1.414	51	-334
Varerelaterte kontrakter						
Børsomsatte standardiserte forwards og futures kontrakter	814	190	-190	1.549	83	-83
Sum varerelaterte kontrakter	814	190	-190	1.549	83	-83
Sikring						
Renteinstrumenter						
Rentebytteavtaler (inkl. cross currency interest rate swap)	36.895	353	-511	37.771	921	-48
Sum renteinstrumenter	36.895	353	-511	37.771	921	-48
Sum						
Sum renteinstrumenter	289.649	2.129	-2.376	289.265	5.852	-5.590
Sum valutainstrumenter	16.919	304	-235	14.455	368	-196
Sum egenkapitalinstrumenter	1.398	33	-409	1.414	51	-334
Sum varerelaterte kontrakter	814	190	-190	1.549	83	-83
Påløpte renter		569	-699		872	-977
Sum finansielle derivater	308.779	3.224	-3.909	306.683	7.226	-7.179