

#### 4. デリバティブ取引の定量的情報

##### (1) 差損益の内訳(ヘッジ会計適用分・非適用分の内訳)

(単位:百万円)

| 区 分       | 平成16年度上半期末 |        |      |      |     | 合計     |
|-----------|------------|--------|------|------|-----|--------|
|           | 金利関連       | 通貨関連   | 株式関連 | 債券関連 | その他 |        |
| ヘッジ会計適用分  | △2,910     | △6,663 | —    | —    | —   | △9,573 |
| ヘッジ会計非適用分 | —          | 7      | △19  | 0    | —   | △11    |
| 合 計       | △2,910     | △6,655 | △19  | 0    | —   | △9,584 |

(単位:百万円)

| 区 分       | 平成17年度上半期末 |      |      |      |     | 合計     |
|-----------|------------|------|------|------|-----|--------|
|           | 金利関連       | 通貨関連 | 株式関連 | 債券関連 | その他 |        |
| ヘッジ会計適用分  | △6,140     | —    | —    | —    | —   | △6,140 |
| ヘッジ会計非適用分 | —          | △64  | 68   | —    | —   | 3      |
| 合 計       | △6,140     | △64  | 68   | —    | —   | △6,136 |

(単位:百万円)

| 区 分       | 平成16年度末 |        |      |      |     | 合計      |
|-----------|---------|--------|------|------|-----|---------|
|           | 金利関連    | 通貨関連   | 株式関連 | 債券関連 | その他 |         |
| ヘッジ会計適用分  | △5,563  | △4,788 | —    | —    | —   | △10,351 |
| ヘッジ会計非適用分 | —       | △2     | △7   | —    | —   | △9      |
| 合 計       | △5,563  | △4,790 | △7   | —    | —   | △10,361 |

(注) ヘッジ会計適用分のうち時価ヘッジ適用分の差損益(平成16年度上半期末:通貨関連△6,663百万円、平成16年度末:通貨関連△4,788百万円)、およびヘッジ会計非適用分の差損益は、損益計算書に計上しています。

##### (2) 金利関連(ヘッジ会計適用分・非適用分の合算値)

(単位:百万円)

| 区 分              | 平成16年度上半期末 |         |        |        | 平成17年度上半期末 |         |        |        |
|------------------|------------|---------|--------|--------|------------|---------|--------|--------|
|                  | 契約額等       | 時価      |        | 差損益    | 契約額等       | 時価      |        | 差損益    |
|                  |            | うち1年超   |        |        |            | うち1年超   |        |        |
| 金利スワップ           |            |         |        |        |            |         |        |        |
| 店頭 固定金利受取/変動金利支払 | 307,011    | 237,211 | 4,536  | 4,536  | 260,610    | 127,985 | 1,641  | 1,641  |
| 固定金利支払/変動金利受取    | 103,000    | 103,000 | △7,446 | △7,446 | 103,000    | 100,000 | △7,781 | △7,781 |
| 合 計              |            |         |        | △2,910 |            |         |        | △6,140 |

(単位:百万円)

| 区 分              | 平成16年度末 |         |        |        |
|------------------|---------|---------|--------|--------|
|                  | 契約額等    | 時価      |        | 差損益    |
|                  |         | うち1年超   |        |        |
| 金利スワップ           |         |         |        |        |
| 店頭 固定金利受取/変動金利支払 | 307,357 | 152,932 | 3,590  | 3,590  |
| 固定金利支払/変動金利受取    | 103,000 | 103,000 | △9,153 | △9,153 |
| 合 計              |         |         |        | △5,563 |

##### 【参考】金利スワップ契約の残存期間別構成

(単位:百万円、%)

| 区 分            |        | 平成16年度上半期末 |             |             |             |              |         | 合計      |
|----------------|--------|------------|-------------|-------------|-------------|--------------|---------|---------|
|                |        | 1年以下       | 1年超<br>3年以下 | 3年超<br>5年以下 | 5年超<br>7年以下 | 7年超<br>10年以下 | 10年超    |         |
|                |        | 固定金利受取     | 想定元本        | 69,800      | 190,266     | 26,280       | 19,665  |         |
| 変動金利支払<br>スワップ | 平均受取金利 | 1.29       | 1.37        | 1.23        | 0.99        | 1.18         | —       | 1.32    |
|                | 平均支払金利 | 0.15       | 0.14        | 0.39        | 0.14        | 0.22         | —       | 0.17    |
| 固定金利支払         | 想定元本   | —          | 3,000       | —           | —           | —            | 100,000 | 103,000 |
|                | 平均受取金利 | —          | 0.11        | —           | —           | —            | 1.25    | 1.21    |
| 変動金利受取<br>スワップ | 平均支払金利 | —          | 3.13        | —           | —           | —            | 3.57    | 3.56    |

(単位:百万円、%)

| 区 分            |        | 平成17年度上半期末 |             |             |             |              |         | 合計      |
|----------------|--------|------------|-------------|-------------|-------------|--------------|---------|---------|
|                |        | 1年以下       | 1年超<br>3年以下 | 3年超<br>5年以下 | 5年超<br>7年以下 | 7年超<br>10年以下 | 10年超    |         |
|                |        | 固定金利受取     | 想定元本        | 132,625     | 74,425      | 15,080       | 19,167  |         |
| 変動金利支払<br>スワップ | 平均受取金利 | 1.36       | 1.37        | 1.13        | 1.00        | 1.31         | —       | 1.32    |
|                | 平均支払金利 | 0.12       | 0.26        | 0.35        | 0.08        | 0.20         | —       | 0.18    |
| 固定金利支払         | 想定元本   | 3,000      | —           | —           | —           | —            | 100,000 | 103,000 |
|                | 平均受取金利 | 0.12       | —           | —           | —           | —            | 1.25    | 1.22    |
| 変動金利受取<br>スワップ | 平均支払金利 | 3.13       | —           | —           | —           | —            | 3.57    | 3.56    |

(単位:百万円、%)

| 区 分            |        | 平成16年度末 |             |             |             |              |         | 合計      |
|----------------|--------|---------|-------------|-------------|-------------|--------------|---------|---------|
|                |        | 1年以下    | 1年超<br>3年以下 | 3年超<br>5年以下 | 5年超<br>7年以下 | 7年超<br>10年以下 | 10年超    |         |
|                |        | 固定金利受取  | 想定元本        | 154,425     | 97,033      | 22,630       | 19,668  |         |
| 変動金利支払<br>スワップ | 平均受取金利 | 1.44    | 1.26        | 1.03        | 1.00        | 1.25         | —       | 1.32    |
|                | 平均支払金利 | 0.11    | 0.26        | 0.36        | 0.08        | 0.17         | —       | 0.18    |
| 固定金利支払         | 想定元本   | —       | 3,000       | —           | —           | —            | 100,000 | 103,000 |
|                | 平均受取金利 | —       | 0.07        | —           | —           | —            | 1.25    | 1.22    |
| 変動金利受取<br>スワップ | 平均支払金利 | —       | 3.13        | —           | —           | —            | 3.57    | 3.56    |

## (3)通貨関連 (ヘッジ会計適用分・非適用分の合算値)

(単位:百万円)

| 区 分    | 平成16年度上半期末 |         |    |         | 平成17年度上半期末 |        |       |        | 平成16年度末 |         |      |         |        |     |
|--------|------------|---------|----|---------|------------|--------|-------|--------|---------|---------|------|---------|--------|-----|
|        | 契約額等       |         |    | 時価      | 差損益        | 契約額等   |       |        | 時価      | 差損益     | 契約額等 |         |        | 差損益 |
|        |            | うち1年超   |    |         |            |        | うち1年超 |        |         |         |      | うち1年超   |        |     |
| 店<br>頭 | 為替予約       |         |    |         |            |        |       |        |         |         |      |         |        |     |
|        | 売建         | 429,408 | -  | 436,070 | △6,661     | 31,588 | -     | 31,672 | △83     | 214,391 | -    | 219,210 | △4,819 |     |
|        | 米ドル        | 429,139 | -  | 435,802 | △6,662     | 2,964  | -     | 3,040  | △75     | 202,122 | -    | 206,903 | △4,780 |     |
|        | ユーロ        | 118     | -  | 118     | 0          | 28,621 | -     | 28,629 | △8      | 10,736  | -    | 10,770  | △34    |     |
|        | 英ポンド       | 92      | -  | 92      | 0          | -      | -     | -      | -       | 892     | -    | 898     | △5     |     |
|        | その他        | 57      | -  | 56      | 0          | 2      | -     | 2      | △0      | 639     | -    | 637     | 1      |     |
|        | 買建         | 12,233  | -  | 12,239  | 6          | 2,191  | -     | 2,210  | 18      | 6,273   | -    | 6,301   | 28     |     |
|        | 米ドル        | 8,535   | -  | 8,520   | △15        | 481    | -     | 494    | 12      | 1,881   | -    | 1,891   | 9      |     |
|        | ユーロ        | 379     | -  | 384     | 5          | 1,698  | -     | 1,705  | 6       | 2,661   | -    | 2,668   | 7      |     |
|        | 英ポンド       | 3,219   | -  | 3,236   | 16         | 11     | -     | 11     | △0      | 1,637   | -    | 1,648   | 10     |     |
| その他    | 98         | -       | 98 | △0      | -          | -      | -     | -      | 92      | -       | 93   | 0       |        |     |
| 合 計    |            |         |    | △6,655  |            |        |       | △64    |         |         |      | △4,790  |        |     |

(注) 為替予約等が付されていることにより、決済時における円貨額が確定し、貸借対照表において当該円貨額で表示されている外貨建金銭債権債務等にかかる取引を除いています。

## (4)株式関連 (ヘッジ会計適用分・非適用分の合算値)

(単位:百万円)

| 区 分         | 平成16年度上半期末 |       |     |     | 平成17年度上半期末 |      |       |     | 平成16年度末 |     |      |       |    |     |
|-------------|------------|-------|-----|-----|------------|------|-------|-----|---------|-----|------|-------|----|-----|
|             | 契約額等       |       |     | 時価  | 差損益        | 契約額等 |       |     | 時価      | 差損益 | 契約額等 |       |    | 差損益 |
|             |            | うち1年超 |     |     |            |      | うち1年超 |     |         |     |      | うち1年超 |    |     |
| 取<br>引<br>所 | 株価指数先物     |       |     |     |            |      |       |     |         |     |      |       |    |     |
|             | 買建         | 491   | -   | 474 | △16        | 626  | -     | 690 | 63      | 951 | -    | 944   | △6 |     |
|             | 外国株価指数先物   |       |     |     |            |      |       |     |         |     |      |       |    |     |
| 買建          | 309        | -     | 307 | △2  | 843        | -    | 848   | 5   | 836     | -   | 835  | △0    |    |     |
| 合 計         |            |       |     | △19 |            |      |       | 68  |         |     |      | △7    |    |     |

## (5)債券関連 (ヘッジ会計適用分・非適用分の合算値)

(単位:百万円)

| 区 分         | 平成16年度上半期末 |       |    |    | 平成17年度上半期末 |      |       |   | 平成16年度末 |     |      |       |   |     |
|-------------|------------|-------|----|----|------------|------|-------|---|---------|-----|------|-------|---|-----|
|             | 契約額等       |       |    | 時価 | 差損益        | 契約額等 |       |   | 時価      | 差損益 | 契約額等 |       |   | 差損益 |
|             |            | うち1年超 |    |    |            |      | うち1年超 |   |         |     |      | うち1年超 |   |     |
| 取<br>引<br>所 | 債券指数先物     |       |    |    |            |      |       |   |         |     |      |       |   |     |
|             | 買建         | -     | -  | -  | -          | -    | -     | - | -       | -   | -    | -     | - |     |
|             | 外国債券指数先物   |       |    |    |            |      |       |   |         |     |      |       |   |     |
| 買建          | 88         | -     | 88 | 0  | -          | -    | -     | - | -       | -   | -    | -     |   |     |
| 合 計         |            |       |    | 0  |            |      |       | - |         |     |      | -     |   |     |