

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17年度上半期末					
	金利関連	通貨関連	株式関連	債券関連	その他	合計
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18年度上半期末					
	金利関連	通貨関連	株式関連	債券関連	その他	合計
ヘッジ会計適用分	△5,473	—	—	—	—	△5,473
ヘッジ会計非適用分	—	△72	7	—	—	△65
合 計	△5,473	△72	7	—	—	△5,538

(単位:百万円)

区 分	平成17年度末					
	金利関連	通貨関連	株式関連	債券関連	その他	合計
ヘッジ会計適用分	△4,462	—	—	—	—	△4,462
ヘッジ会計非適用分	—	15	65	—	—	81
合 計	△4,462	15	65	—	—	△4,381

(注) 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17年度上半期末				平成18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			
店 頭	金利スワップ 固定金利受取/変動金利支払	260,610	127,985	1,641	1,641	146,154	89,946	△388	△388
	固定金利支払/変動金利受取	103,000	100,000	△7,781	△7,781	100,000	100,000	△5,085	△5,085
	合 計								△5,473

(単位:百万円)

区 分	平成17年度末				
	契約額等	時価		差損益	
		うち1年超			
店 頭	金利スワップ 固定金利受取/変動金利支払	173,425	99,109	△1,226	△1,226
	固定金利支払/変動金利受取	103,000	100,000	△3,236	△3,236
	合 計				△4,462

【ご参考】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17年度上半期末						
		1年以下	1年超 3年以下	3年超 5年以下	5年超 7年以下	7年超 10年以下	10年超	合計
固定金利受取 変動金利支払	想定元本	132,625	74,425	15,080	19,167	19,312	—	260,610
	平均受取金利	1.36	1.37	1.13	1.00	1.31	—	1.32
スワップ	平均支払金利	0.12	0.26	0.35	0.08	0.20	—	0.18
	固定金利支払 変動金利受取	想定元本	3,000	—	—	—	—	100,000
	平均受取金利	0.12	—	—	—	—	1.25	1.22
	平均支払金利	3.13	—	—	—	—	3.57	3.56

(単位:百万円、%)

区 分		平成18年度上半期末						
		1年以下	1年超 3年以下	3年超 5年以下	5年超 7年以下	7年超 10年以下	10年超	合計
固定金利受取 変動金利支払	想定元本	56,208	28,780	27,483	16,400	17,282	—	146,154
	平均受取金利	1.40	1.27	1.03	1.36	1.66	—	1.33
スワップ	平均支払金利	0.53	0.78	0.49	0.62	0.52	—	0.58
	固定金利支払 変動金利受取	想定元本	—	—	—	—	100,000	—
	平均受取金利	—	—	—	—	1.37	—	1.37
	平均支払金利	—	—	—	—	3.57	—	3.57

(単位:百万円、%)

区 分		平成17年度末						
		1年以下	1年超 3年以下	3年超 5年以下	5年超 7年以下	7年超 10年以下	10年超	合計
固定金利受取 変動金利支払	想定元本	74,316	36,780	30,954	14,000	17,375	—	173,425
	平均受取金利	1.16	1.43	0.93	1.23	1.67	—	1.23
スワップ	平均支払金利	0.25	0.41	0.18	0.21	0.26	—	0.27
	固定金利支払 変動金利受取	想定元本	3,000	—	—	—	—	100,000
	平均受取金利	0.13	—	—	—	—	1.27	1.23
	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17年度上半期末				平成18年度上半期末				平成17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		時価	差損益	
	うち1年超				うち1年超				うち1年超				
店 頭	為替予約 売建	31,588	—	31,672	△83	8,926	—	9,009	△83	626	—	631	△4
	米ドル	2,964	—	3,040	△75	3,010	—	3,020	△10	199	—	200	△1
	ユーロ	28,621	—	28,629	△8	5,913	—	5,987	△73	352	—	356	△3
	英ポンド	—	—	—	—	—	—	—	—	42	—	42	0
	その他	2	—	2	△0	2	—	2	△0	32	—	32	0
	買建	2,191	—	2,210	18	3,424	—	3,435	11	8,564	—	8,584	20
	米ドル	481	—	494	12	3,107	—	3,118	10	3,107	—	3,118	11
	ユーロ	1,698	—	1,705	6	306	—	306	0	4,221	—	4,230	8
	英ポンド	11	—	11	△0	10	—	10	0	599	—	599	△0
	その他	—	—	—	—	—	—	—	—	635	—	636	0
合 計				△64				△72				15	

(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17年度上半期末				平成18年度上半期末				平成17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		時価	差損益	
	うち1年超				うち1年超				うち1年超				
取引所	株価指数先物 買建	626	—	690	63	1,217	—	1,211	△6	1,197	—	1,261	63
	外国株価指数先物 買建	843	—	848	5	822	—	836	13	930	—	933	2
	合 計				68				7				65

(5) 債券関連 (ヘッジ会計適用分・非適用分の合算値)

平成17年度上半期末、平成18年度上半期末および平成17年度末とも保有していません。