

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

(単位:百万円)

区 分	平成17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	△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) ヘッジ会計適用分のうち時価ヘッジ適用分の差損益(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
		うち1年超				うち1年超		
金利スワップ								
店 固定金利受取/変動金利支払	307,357	152,932	3,590	3,590	173,425	99,109	△1,226	△1,226
頭 固定金利支払/変動金利受取	103,000	103,000	△9,153	△9,153	103,000	100,000	△3,236	△3,236
合 計				△5,563				△4,462

【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年度末							合計
	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		
固定金利受取	154,425	97,033	22,630	19,668	13,600	—	307,357	
変動金利支払	1.44	1.26	1.03	1.00	1.25	—	1.32	
スワップ	0.11	0.26	0.36	0.08	0.17	—	0.18	
固定金利支払	—	3,000	—	—	—	100,000	103,000	
変動金利受取	—	0.07	—	—	—	1.25	1.22	
スワップ	—	3.13	—	—	—	3.57	3.56	

(単位:百万円、%)

区 分	平成17年度末							合計
	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		
固定金利受取	74,316	36,780	30,954	14,000	17,375	—	173,425	
変動金利支払	1.16	1.43	0.93	1.23	1.67	—	1.23	
スワップ	0.25	0.41	0.18	0.21	0.26	—	0.27	
固定金利支払	3,000	—	—	—	—	100,000	103,000	
変動金利受取	0.13	—	—	—	—	1.27	1.23	
スワップ	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年度末				平成17年度末				
	契約額等	うち1年超	時価	差損益	契約額等	うち1年超	時価	差損益	
店 頭	為替予約								
	売建	214,391	—	219,210	△4,819	626	—	631	△4
	米ドル	202,122	—	206,903	△4,780	199	—	200	△1
	ユーロ	10,736	—	10,770	△34	352	—	356	△3
	英ポンド	892	—	898	△5	42	—	42	0
	その他	639	—	637	1	32	—	32	0
	買建	6,273	—	6,301	28	8,564	—	8,584	20
	米ドル	1,881	—	1,891	9	3,107	—	3,118	11
	ユーロ	2,661	—	2,668	7	4,221	—	4,230	8
	英ポンド	1,637	—	1,648	10	599	—	599	△0
	その他	92	—	93	0	635	—	636	0
	合 計				△4,790				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16年度末				平成17年度末				
	契約額等	うち1年超	時価	差損益	契約額等	うち1年超	時価	差損益	
取 引 所	株価指数先物								
	買建	951	—	944	△6	1,197	—	1,261	63
	外国株価指数先物								
買建	836	—	835	△0	930	—	933	2	
合 計				△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16年度末、平成17年度末とも保有していません。