

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18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	△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19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	△5,700	—	—	—	—	△5,700
ヘッジ会計非適用分	—	12	143	—	—	155
合 計	△5,700	12	143	—	—	△5,544

(単位:百万円)

区 分	平成18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	△5,982	—	—	—	—	△5,982
ヘッジ会計非適用分	—	16	37	—	—	53
合 計	△5,982	16	37	—	—	△5,929

(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18年度上半期末				平成19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 金利スワップ								
店 固定金利受取/変動金利支払	146,154	89,946	△388	△388	108,338	90,338	△657	△657
店 固定金利支払/変動金利受取	100,000	100,000	△5,085	△5,085	100,000	100,000	△5,042	△5,042
合 計				△5,473				△5,700

(単位:百万円)

区 分	平成18年度末			
	契約額等	時価		差損益
		うち1年超		
店 金利スワップ				
店 固定金利受取/変動金利支払	114,795	93,295	△593	△593
店 固定金利支払/変動金利受取	100,000	100,000	△5,388	△5,388
合 計				△5,982

【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18年度上半期末						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 変動金利支払 スワップ	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
	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 スワップ	想定元本	—	—	—	—	100,000	—	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19年度上半期末						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 変動金利支払 スワップ	想定元本	18,000	16,040	21,200	21,000	32,097	—	108,338
	平均受取金利	1.27	1.15	1.09	1.46	1.81	—	1.41
	平均支払金利	1.28	1.20	1.02	1.00	1.11	—	1.11
固定金利支払 変動金利受取 スワップ	想定元本	—	—	—	—	100,000	—	100,000
	平均受取金利	—	—	—	—	1.91	—	1.91
	平均支払金利	—	—	—	—	3.57	—	3.57

(単位:百万円、%)

区 分		平成18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 変動金利支払 スワップ	想定元本	21,500	23,530	24,575	18,000	27,190	—	114,795
	平均受取金利	1.61	1.04	1.07	1.39	1.77	—	1.38
	平均支払金利	0.97	0.86	0.75	0.72	0.83	—	0.83
固定金利支払 変動金利受取 スワップ	想定元本	—	—	—	—	100,000	—	100,000
	平均受取金利	—	—	—	—	1.73	—	1.73
	平均支払金利	—	—	—	—	3.57	—	3.57

(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18年度上半期末				平成19年度上半期末				平成18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	8,926	—	9,009	△83	551	—	561	△9	14	—	14	△0
	米ドル	3,010	—	3,020	△10	365	—	364	0	3	—	3	△0
	ユーロ	5,913	—	5,987	△73	185	—	195	△10	6	—	6	△0
	英ポンド	—	—	—	—	—	—	—	—	2	—	2	△0
	その他	2	—	2	△0	0	—	0	△0	1	—	1	△0
	買建	3,424	—	3,435	11	1,302	—	1,324	22	1,351	—	1,368	16
	米ドル	3,107	—	3,118	10	716	—	718	1	780	—	786	6
	ユーロ	306	—	306	0	547	—	567	20	504	—	514	9
	英ポンド	10	—	10	0	7	—	7	0	66	—	67	0
その他	—	—	—	—	30	—	31	0	—	—	—	—	
合 計				△72				12				16	

(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18年度上半期末				平成19年度上半期末				平成18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	1,217	—	1,211	△6	2,946	—	3,085	139	2,110	—	2,111	1
	外国株価指数先物												
	売建	—	—	—	—	15	—	16	△0	—	—	—	—
買建	822	—	836	13	1,780	—	1,784	4	1,791	—	1,827	36	
合 計				7				143				37	

(5) 債券関連 (ヘッジ会計適用分・非適用分の合算値)

平成18年度上半期末、平成19年度上半期末および平成18年度末とも保有していません。