

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19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	△7,030	1,071	—	—	—	△5,958
ヘッジ会計非適用分	—	3,936	5	—	—	3,941
合 計	△7,030	5,007	5	—	—	△2,017

(単位:百万円)

区 分	平成20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	2,113	△25,145	—	—	—	△23,031
ヘッジ会計非適用分	△26	△34,382	612	—	—	△33,796
合 計	2,087	△59,527	612	—	—	△56,828

(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19年度末:通貨関連1,071百万円、平成20年度末:通貨関連△25,145百万円)、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)

店 頭	区 分	平成19年度末			平成20年度末			
		契約額等	時価		契約額等	時価		差損益
			うち1年超	差損益		うち1年超	差損益	
	金利スワップ							
	固定金利受取/変動金利支払	107,678	92,398	1,370	103,426	96,276	2,087	
	固定金利支払/変動金利受取	100,000	100,000	△8,401	—	—	—	
	合 計			△7,030			2,087	

【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19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	15,280	28,898	15,495	9,125	37,880	1,000	107,678
	平均受取金利	1.17	0.95	1.30	1.81	1.80	1.60	1.41
固定金利支払 変動金利受取 スワップ	平均支払金利	1.27	1.02	1.09	1.11	1.15	1.08	1.12
	想定元本	—	—	—	—	100,000	—	100,000
平均受取金利	平均受取金利	—	—	—	—	2.21	—	2.21
	平均支払金利	—	—	—	—	3.57	—	3.57

(単位:百万円、%)

区 分		平成20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	7,150	22,092	19,210	24,220	29,800	954	103,426
	平均受取金利	0.76	1.08	1.40	1.54	1.87	1.60	1.46
平均支払金利	平均支払金利	0.77	0.82	0.96	1.05	0.95	1.09	0.94
	想定元本	—	—	—	—	—	—	—
平均受取金利	平均受取金利	—	—	—	—	—	—	—
	平均支払金利	—	—	—	—	—	—	—

(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19年度末				平成20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	31,561	9,290	30,495	1,066	1,212,617	—	1,272,172	△59,554
	米ドル	30,068	9,290	28,997	1,070	809,032	—	844,574	△35,541
	ユーロ	576	—	579	△2	380,069	—	402,387	△22,318
	英ポンド	272	—	273	△1	23,308	—	25,002	△1,693
	その他	644	—	644	△0	207	—	209	△1
	買建	1,430	—	1,420	△9	1,912	—	1,940	27
	米ドル	637	—	623	△14	1,044	—	1,052	7
	ユーロ	672	—	675	3	714	—	731	17
	英ポンド	46	—	46	△0	97	—	98	0
	その他	74	—	75	0	56	—	58	1
	通貨オプション								
	買建								
	ブット	300,000	—			—	—		
(918)			4,869	3,951	(—)		—	—	
米ドル	300,000	—			—	—			
(918)			4,869	3,951	(—)		—	—	
合 計				5,007				△59,527	

(注) 1. ()内には、貸借対照表に計上したオプション料を記載しています。

2. 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19年度末				平成20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								
	売建	639	—	632	7	—	—	—	
	買建	1,754	—	1,750	△4	7,493	—	8,104	610
	外国株価指数先物								
買建	914	—	916	1	607	—	609	2	
合 計				5				612	

(5) 債券関連(ヘッジ会計適用分・非適用分の合算値)

平成19年度末、平成20年度末とも保有していません。