

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年度第2四半期(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20年度第2四半期(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	△5,657	6,188	—	—	—	530
ヘッジ会計非適用分	—	1,199	△665	—	—	533
合 計	△5,657	7,387	△665	—	—	1,064

(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

(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20年度第2四半期(上半期)末:通貨関連6,188百万円、平成19年度末:通貨関連1,071百万円)、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年度第2四半期(上半期)末				平成20年度第2四半期(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								
	固定金利受取/変動金利支払	108,338	90,338	△657	△657	101,712	91,232	319	319
	固定金利支払/変動金利受取	100,000	100,000	△5,042	△5,042	100,000	100,000	△5,977	△5,977
	合 計				△5,700				△5,657

(単位:百万円)

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

【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年度第2四半期(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20年度第2四半期(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	10,480	24,660	17,560	10,187	37,825	1,000	101,712
	平均受取金利	1.28	1.04	1.37	1.61	1.90	1.60	1.50
	平均支払金利	1.25	1.02	1.12	1.10	1.15	1.06	1.12
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	—	—	—	—	2.17	—	2.17
	平均支払金利	—	—	—	—	3.57	—	3.57

(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
	平均支払金利	1.27	1.02	1.09	1.11	1.15	1.08	1.12
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	—	—	—	—	2.21	—	2.21
	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19年度第2四半期(上半期)末				平成20年度第2四半期(上半期)末				平成19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	為替予約												
	売建	551	—	561	△9	259,933	8,921	252,445	7,488	31,561	9,290	30,495	1,066
	米ドル	365	—	364	0	248,272	8,921	240,962	7,309	30,068	9,290	28,997	1,070
	ユーロ	185	—	195	△10	8,973	—	8,847	125	576	—	579	△2
	スイスフラン	—	—	—	—	2,412	—	2,356	56	89	—	89	△0
	その他	0	—	0	△0	275	—	277	△2	827	—	828	△0
	買建	1,302	—	1,324	22	10,775	—	10,674	△101	1,430	—	1,420	△9
	米ドル	716	—	718	1	4,540	—	4,531	△8	637	—	623	△14
	ユーロ	547	—	567	20	5,258	—	5,156	△102	672	—	675	3
	香港ドル	—	—	—	—	232	—	236	4	—	—	—	—
その他	37	—	38	0	744	—	749	5	121	—	121	0	
頭	通貨オプション												
	買建												
	ブット	—	—	—	—	—	—	—	—	300,000	—	—	—
	米ドル	(—)	—	—	—	(—)	—	—	—	(918)	—	4,869	3,951
合計				12				7,387				5,007	

(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年度第2四半期(上半期)末				平成20年度第2四半期(上半期)末				平成19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												
	売建	—	—	—	—	—	—	—	—	639	—	632	7
	買建	2,946	—	3,085	139	7,574	—	7,059	△515	1,754	—	1,750	△4
	外国株価指数先物												
	売建	15	—	16	△0	—	—	—	—	—	—	—	—
買建	1,780	—	1,784	4	2,859	—	2,708	△150	914	—	916	1	
合計				143				△665				5	

(5) 債券関連 (ヘッジ会計適用分・非適用分の合算値)

平成19年度第2四半期(上半期)末、平成20年度第2四半期(上半期)末および平成19年度末とも保有していません。