

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21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	2,649	1,904	—	—	—	4,554
ヘッジ会計非適用分	△284	△3,489	13	—	—	△3,760
合 計	2,365	△1,584	13	—	—	793

(単位:百万円)

区 分	平成22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	3,925	△20,301	—	—	—	△16,376
ヘッジ会計非適用分	△232	4	△18	—	—	△246
合 計	3,692	△20,297	△18	—	—	△16,622

(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21年度末:通貨関連1,904百万円、平成22年度末:通貨関連△20,301百万円)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) ヘッジ会計が適用されていないもの

○金利関連

(単位:百万円)

店 頭	区 分	平成21年度末				平成22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 固定金利受取/変動金利支払	51,900	51,900	△284	△284	44,400	44,400	△232	△232
	合 計				△284				△232

(注) 金利スワップの差損益は、時価を記載しています。

【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21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	—	—	—	—	—	51,900	51,900
	平均受取金利	—	—	—	—	—	1.88	1.88
	平均支払金利	—	—	—	—	—	0.46	0.46

(単位:百万円、%)

区 分		平成22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	—	—	—	—	—	44,400	44,400
	平均受取金利	—	—	—	—	—	2.10	2.10
	平均支払金利	—	—	—	—	—	0.35	0.35

○通貨関連

(単位:百万円)

区 分	平成21年度末				平成22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	129,163	—	△3,531	△3,531	544	—	△7	△7	
	米ドル	128,532	—	△3,520	△3,520	241	—	△1	△1	
	豪ドル	177	—	△1	△1	153	—	△1	△1	
	ユーロ	289	—	△6	△6	150	—	△4	△4	
	その他	164	—	△3	△3	—	—	—	—	
	買建	3,684	—	42	42	1,029	—	12	12	
	米ドル	1,978	—	16	16	587	—	3	3	
	ユーロ	931	—	19	19	434	—	9	9	
	その他	774	—	6	6	6	—	△0	△0	
	合 計				△3,489					4

(注) 為替予約の差損益は、時価を記載しています。

○株式関連

(単位:百万円)

区 分	平成21年度末				平成22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	514	—	13	13	1,770	—	△30	△30	
	外国株価指数先物									
	買建	1,075	—	△0	△0	262	—	12	12	
合 計				13					△18	

(注) 株価指数先物および外国株価指数先物の差損益は、時価を記載しています。

○債券関連

平成21年度末および平成22年度末とも保有していません。

(3)ヘッジ会計が適用されているもの

○金利関連

(単位:百万円)

ヘッジ会計の方法	種類	主なヘッジ対象	平成21年度末		
			契約額等	時価	
				うち1年超	
繰延ヘッジ	金利スワップ 固定金利受取/変動金利支払	貸付金および 保険負債	9,430	8,755	85
金利スワップの特例処理	金利スワップ 固定金利受取/変動金利支払	貸付金	84,944	67,028	2,564
合 計					2,649

(単位:百万円)

ヘッジ会計の方法	種類	主なヘッジ対象	平成22年度末		
			契約額等	時価	
				うち1年超	
繰延ヘッジ	金利スワップ 固定金利受取/変動金利支払	貸付金および 保険負債	54,400	54,100	1,201
金利スワップの特例処理	金利スワップ 固定金利受取/変動金利支払	貸付金	66,572	65,072	2,723
合 計					3,925

【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21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	18,591	15,355	11,505	31,060	17,863	—	94,374
	平均受取金利	1.01	1.29	1.61	1.65	1.93	—	1.51
	平均支払金利	0.40	0.61	0.59	0.61	0.61	—	0.56

(単位:百万円、%)

区 分		平成22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	1,800	18,850	21,050	24,800	9,872	44,600	120,972
	平均受取金利	1.65	1.39	1.60	1.81	1.84	1.92	1.75
	平均支払金利	0.73	0.45	0.50	0.49	0.46	0.35	0.43

○通貨関連

(単位:百万円)

ヘッジ会計の方法	種類	主なヘッジ対象	平成21年度末		時価
			契約額等	うち1年超	
時価ヘッジ	為替予約	外貨建債券			
	売建		851,092	—	1,904
	米ドル		461,053	—	△15,617
	ユーロ		277,775	—	14,884
	英ポンド		112,263	—	2,636
合 計					1,904

(単位:百万円)

ヘッジ会計の方法	種類	主なヘッジ対象	平成22年度末		時価
			契約額等	うち1年超	
時価ヘッジ	為替予約	外貨建債券			
	売建		877,804	—	△20,301
	米ドル		678,568	—	△9,997
	ユーロ		199,236	—	△10,304
合 計					△20,301

○株式関連

平成21年度末および平成22年度末とも保有していません。

○債券関連

平成21年度末および平成22年度末とも保有していません。