

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22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	6,928	21,400	—	—	—	28,329
ヘッジ会計非適用分	63	19	57	—	—	141
合 計	6,992	21,420	57	—	—	28,470

(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

(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22年度第2四半期(上半期)末:通貨関連21,400百万円、平成21年度末:通貨関連1,904百万円)、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)

区 分	平成22年度第2四半期(上半期)末			
	契約額等	時価		差損益
		うち1年超		
店頭 金利スワップ 固定金利受取/変動金利支払	2,800	2,800	63	63
合 計				63

平成21年度末			
契約額等	時価		差損益
	うち1年超		
51,900	51,900	△284	△284
			△284

(注) 金利スワップの時価は、差損益を記載しています。

【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22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	—	—	2,800	—	—	—	2,800
	平均受取金利	—	—	0.97	—	—	—	0.97
	平均支払金利	—	—	0.43	—	—	—	0.43

(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

○通貨関連

(単位:百万円)

区 分		平成22年度第2四半期(上半期)末			
		契約額等		時価	差損益
			うち1年超		
店 頭	為替予約				
	売建	381	—	△1	△1
	豪ドル	145	—	△0	△0
	米ドル	135	—	0	0
	カナダドル	82	—	△0	△0
	その他	17	—	△1	△1
	買建	910	—	21	21
	米ドル	557	—	△0	△0
	ユーロ	346	—	21	21
	その他	6	—	0	0
合 計					19

(単位:百万円)

区 分		平成21年度末			
		契約額等		時価	差損益
			うち1年超		
店 頭	為替予約				
	売建	129,163	—	△3,531	△3,531
	米ドル	128,532	—	△3,520	△3,520
	その他	631	—	△10	△10
	買建	3,684	—	42	42
	米ドル	1,978	—	16	16
	ユーロ	931	—	19	19
	その他	774	—	6	6
合 計					△3,489

(注) 1. 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。

2. 為替予約の時価は、差損益を記載しています。

○株式関連

(単位:百万円)

区 分		平成22年度第2四半期(上半期)末			
		契約額等		時価	差損益
			うち1年超		
取 引 所	株価指数先物				
	買建	3,407	—	55	55
	外国株価指数先物				
	買建	440	—	2	2
合 計					57

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

平成21年度末			
契約額等		時価	差損益
	うち1年超		
	514	—	13
	1,075	—	△0
			13

○債券関連

平成22年度第2四半期(上半期)末および平成21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22年度第2四半期(上半期)末		
			契約額等		時価
				うち1年超	
繰延ヘッジ	金利スワップ	貸付金および 保険負債	57,775	57,300	3,492
	固定金利受取/変動金利支払				
金利スワップの特例処理	金利スワップ	貸付金	82,208	65,300	3,436
	固定金利受取/変動金利支払				
合 計					6,928

(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	貸付金および 保険負債	9,430	8,755	85
	固定金利受取/変動金利支払				
金利スワップの特例処理	金利スワップ	貸付金	84,944	67,028	2,564
	固定金利受取/変動金利支払				
合 計					2,649

(注) 金利スワップの時価は、差損益を記載しています。

【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22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	17,383	16,840	10,037	36,005	7,818	51,900	139,983
	平均受取金利	1.09	1.36	1.61	1.75	1.96	1.88	1.67
	平均支払金利	0.37	0.56	0.56	0.56	0.63	0.44	0.49

(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

○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22年度第2四半期(上半期)末		
			契約額等		時価
				うち1年超	
時価ヘッジ	為替予約 売建	外貨建 債券	773,623	—	21,400
	米ドル		684,646	—	17,843
	ユーロ		88,976	—	3,556
合 計					21,400

(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	
時価ヘッジ	為替予約 売建	外貨建 債券	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

(注) 1. 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。
2. 為替予約の時価は、差損益を記載しています。

○株式関連

平成22年度第2四半期(上半期)末および平成21年度末とも保有していません。

○債券関連

平成22年度第2四半期(上半期)末および平成21年度末とも保有していません。