

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

(単位:百万円)

区 分	平成23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	9,262	12,100	—	—	—	21,362
ヘッジ会計非適用分	467	△30	61	—	—	498
合 計	9,729	12,070	61	—	—	21,861

(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年度末:通貨関連△20,301百万円、平成23年度第2四半期(上半期)末:通貨関連12,100百万円)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22年度末			平成23年度第2四半期(上半期)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
	固定金利受取/変動金利支払	44,400	44,400	△232	△232	13,300	13,300	467	467
	合 計				△232				467

(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

(単位:百万円、%)

区 分		平成23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	—	—	2,600	2,400	—	8,300	13,300
	平均受取金利	—	—	1.03	1.14	—	1.92	1.60
	平均支払金利	—	—	0.33	0.33	—	0.34	0.34

○通貨関連

(単位:百万円)

区 分		平成22年度末				平成23年度第2四半期(上半期)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	544	—	△7	△7	1,736	—	1	1
	米ドル	241	—	△1	△1	941	—	△1	△1
	ユーロ	150	—	△4	△4	455	—	3	3
	豪ドル	153	—	△1	△1	201	—	△1	△1
	その他	—	—	—	—	138	—	0	0
	買建	1,029	—	12	12	2,472	—	△31	△31
	米ドル	587	—	3	3	1,305	—	0	0
	ユーロ	434	—	9	9	961	—	△30	△30
	その他	6	—	△0	△0	205	—	△0	△0
合 計					4				△30

(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22年度末				平成23年度第2四半期(上半期)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	1,770	—	△30	△30	3,997	—	47	47
	外国株価指数先物								
	売建	—	—	—	—	710	—	△5	△5
	買建	262	—	12	12	1,629	—	18	18
合 計					△18				61

(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22年度末および平成23年度第2四半期(上半期)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

(単位:百万円)

ヘッジ会計の方法	種類	主なヘッジ対象	平成23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 固定金利受取/変動金利支払	保険負債	90,500	90,500	6,333
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	64,844	64,844	2,928
合 計					9,262

【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	想 定 元 本	1,800	18,850	21,050	24,800	9,872	44,600	120,972
変動金利支払	平均受取金利	1.65	1.39	1.60	1.81	1.84	1.92	1.75
スワップ	平均支払金利	0.73	0.45	0.50	0.49	0.46	0.35	0.43

(単位:百万円、%)

区 分		平成23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	想 定 元 本	—	20,760	16,357	27,000	4,827	86,400	155,344
変動金利支払	平均受取金利	—	1.46	1.63	1.95	1.52	2.01	1.87
スワップ	平均支払金利	—	0.47	0.48	0.51	0.35	0.34	0.40

○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年度末			平成23年度第2四半期(上半期)末		
			契約額等	時価		契約額等	時価	
				うち1年超			うち1年超	
時価ヘッジ	為替予約	外貨建債券	877,804	—	△20,301	530,000	—	12,100
	売建		678,568	—	△9,997	433,742	—	7,048
	米ドル		199,236	—	△10,304	96,257	—	5,052
	ユーロ							
合計					△20,301			12,100

○株式関連

平成22年度末および平成23年度第2四半期(上半期)末とも保有していません。

○債券関連

平成22年度末および平成23年度第2四半期(上半期)末とも保有していません。