

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					
	金利関連	通貨関連	株式関連	債券関連	その他	合計
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年度末					
	金利関連	通貨関連	株式関連	債券関連	その他	合計
ヘッジ会計適用分	8,226	△14,912	—	—	—	△6,685
ヘッジ会計非適用分	△17	27	△3	—	—	7
合 計	8,209	△14,884	△3	—	—	△6,678

(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年度末:通貨関連△14,912百万円)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	44,400	44,400	△232	△232	51,800	51,800	△17	△17
	合 計				△232				△17

(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						
		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	合計
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年度末						
		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	合計
固定金利受取 変動金利支払 スワップ	想 定 元 本	—	—	—	—	—	51,800	51,800
	平均受取金利	—	—	—	—	—	1.82	1.82
	平均支払金利	—	—	—	—	—	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			
店 頭	為替予約									
	売建	544	—	△7	△7	7,605	—	11	11	
	米ドル	241	—	△1	△1	4,557	—	15	15	
	ユーロ	150	—	△4	△4	1,739	—	△5	△5	
	豪ドル	153	—	△1	△1	300	—	0	0	
	その他	—	—	—	—	1,007	—	1	1	
	買建	1,029	—	12	12	5,444	—	16	16	
	米ドル	587	—	3	3	3,654	—	2	2	
	ユーロ	434	—	9	9	1,745	—	13	13	
	その他	6	—	△0	△0	44	—	0	0	
合 計				4					27	

(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			
取 引 所	株価指数先物									
	買建	1,770	—	△30	△30	4,863	—	3	3	
	外国株価指数先物									
	買建	262	—	12	12	1,936	—	△7	△7	
合 計				△18					△3	

(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	5,576
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	64,616	51,316	2,649
合 計					8,226

【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	13,300	8,195	25,440	17,000	9,181	82,000	155,116
変動金利支払	平均受取金利	1.23	1.82	1.76	1.94	1.56	2.03	1.87
スワップ	平均支払金利	0.44	0.50	0.49	0.49	0.34	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	683,264	—	△14,912
	売建		678,568	—	△9,997	683,264	—	△14,912
	米ドル ユーロ		199,236	—	△10,304	—	—	—
合 計				△20,301			△14,912	

○株式関連

平成22年度末および平成23年度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年度末とも保有していません。