

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23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	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

(単位:百万円)

区 分	平成24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	14,595	△107,777	—	—	—	△93,182
ヘッジ会計非適用分	2,111	4	34	—	—	2,150
合 計	16,706	△107,773	34	—	—	△91,032

(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23年度末:通貨関連△14,912百万円、平成24年度末:通貨関連△107,936百万円)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23年度末			平成24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	51,800	51,800	△17	△17	49,100	49,100	2,111	2,111
	合 計				△17				2,111

(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 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

(単位:百万円、%)

区 分		平成24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	—	—	—	—	—	49,100	49,100
	平均受取金利	—	—	—	—	—	1.82	1.82
	平均支払金利	—	—	—	—	—	0.28	0.28

○通貨関連

(単位:百万円)

区 分	平成23年度末				平成24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	7,605	—	11	11	5,950	—	23	23
	ユーロ	1,739	—	△5	△5	3,086	—	13	13
	米ドル	4,557	—	15	15	1,076	—	8	8
	カナダドル	170	—	0	0	1,007	—	0	0
	その他	1,137	—	1	1	780	—	1	1
	買建	5,444	—	16	16	8,654	—	△19	△19
	ユーロ	1,745	—	13	13	4,409	—	△13	△13
	米ドル	3,654	—	2	2	2,449	—	△6	△6
	カナダドル	12	—	△0	△0	1,064	—	△0	△0
	その他	31	—	0	0	730	—	0	0
	合 計				27				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23年度末				平成24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	4,863	—	3	3	733	—	34	34
	外国株価指数先物								
買建	1,936	—	△7	△7	546	—	△0	△0	
合 計				△3				34	

(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23年度末および平成24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

(単位:百万円)

ヘッジ会計の方法	種類	主なヘッジ対象	平成24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	138,800	138,800	12,272
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	50,861	45,671	2,322
合 計					14,595

【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

(単位:百万円、%)

区 分		平成24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	5,190	18,080	22,000	5,591	12,100	126,700	189,661
変動金利支払	平均受取金利	1.78	1.67	1.90	2.09	1.62	1.96	1.90
スワップ	平均支払金利	0.39	0.44	0.42	0.49	0.27	0.27	0.31

○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23年度末			平成24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	683,264	—	△14,912	1,651,256	—	△107,936
	売建		683,264	—	△14,912	1,508,739	—	△101,766
	米ドル その他		—	—	—	142,516	—	△6,169
繰延ヘッジ	通貨スワップ ユーロ	外貨建債券	—	—	—	9,208	9,208	158
合計					△14,912			△107,777

○株式関連

平成23年度末および平成24年度末とも保有していません。

○債券関連

平成23年度末および平成24年度末とも保有していません。