

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					
	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

(単位:百万円)

区 分	平成24年度第2四半期(上半期)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	14,370	27,770	—	—	—	42,141
ヘッジ会計非適用分	—	△19	65	—	—	46
合 計	14,370	27,751	65	—	—	42,187

(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年度第2四半期(上半期)末:通貨関連27,770百万円)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
	金利スワップ 固定金利受取/変動金利支払	51,800	51,800	△17	△17	—	—	—	—
	合 計			△17	△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

(単位:百万円、%)

区 分		平成24年度第2四半期(上半期)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	—	—	—	—	—	—	—
	平均受取金利	—	—	—	—	—	—	—
	平均支払金利	—	—	—	—	—	—	—

○通貨関連

(単位:百万円)

区 分	平成23年度末				平成24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	7,605	—	11	11	3,878	—	8
	米ドル	4,557	—	15	15	2,645	—	22
	ユーロ	1,739	—	△5	△5	984	—	△14
	その他	1,307	—	1	1	247	—	△0
	買建	5,444	—	16	16	50,636	—	△27
	米ドル	3,654	—	2	2	49,918	—	△32
	ユーロ	1,745	—	13	13	680	—	5
	その他	44	—	0	0	37	—	0
	合 計				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23年度末				平成24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	4,863	—	3	3	5,660	—	13
	外国株価指数先物							
	売建	—	—	—	—	3,695	—	74
	買建	1,936	—	△7	△7	1,077	—	△21
合 計				△3				65

(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	保険負債	90,500	90,500	5,576
	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	64,616	51,316	2,649
	固定金利受取/変動金利支払				
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	保険負債	140,700	140,700	11,776
	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	64,388	47,908	2,593
	固定金利受取/変動金利支払				
合 計					14,370

【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	13,300	8,195	25,440	17,000	9,181	82,000	155,116
	平均受取金利	1.23	1.82	1.76	1.94	1.56	2.03	1.87
	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	16,480	9,887	30,385	7,636	8,100	132,600	205,088
	平均受取金利	1.35	1.61	1.86	1.97	1.56	1.95	1.86
	平均支払金利	0.45	0.47	0.48	0.52	0.33	0.33	0.38

○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 売建 米ドル	外貨建 債券	683,264	—	△14,912	1,639,693	—	27,770
			683,264	—	△14,912	1,639,693	—	27,770
合 計				△14,912			27,770	

○株式関連

平成23年度末および平成24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23年度末および平成24年度第2四半期(上半期)末とも保有していません。