

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24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	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

(単位:百万円)

区 分	平成25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	11,056	11,952	—	—	—	23,008
ヘッジ会計非適用分	390	43	△8	—	—	426
合 計	11,447	11,996	△8	—	—	23,435

(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24年度末:通貨関連△107,936百万円、平成25年度第2四半期(上半期)末:通貨関連11,844百万円)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24年度末				平成25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	49,100	49,100	2,111	2,111	16,000	16,000	390	390
	合 計				2,111				390

(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24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	—	—	—	—	—	49,100	49,100
	平均受取金利	—	—	—	—	—	1.82	1.82
	平均支払金利	—	—	—	—	—	0.28	0.28

(単位:百万円、%)

区 分		平成25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	—	—	—	—	—	16,000	16,000
	平均受取金利	—	—	—	—	—	1.90	1.90
	平均支払金利	—	—	—	—	—	0.24	0.24

○通貨関連

(単位:百万円)

区 分	平成24年度末				平成25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	5,950	—	23	23	2,270	—	14	14	
	米ドル	1,076	—	8	8	981	—	6	6	
	ユーロ	3,086	—	13	13	751	—	3	3	
	豪ドル	266	—	1	1	261	—	4	4	
	カナダドル	1,007	—	0	0	46	—	0	0	
	その他	514	—	△0	△0	227	—	△0	△0	
	買建	8,654	—	△19	△19	26,091	—	29	29	
	タイバーツ	—	—	—	—	24,327	—	48	48	
	米ドル	2,449	—	△6	△6	1,039	—	△15	△15	
	ユーロ	4,409	—	△13	△13	706	—	△3	△3	
	カナダドル	1,064	—	△0	△0	—	—	—	—	
	その他	730	—	0	0	18	—	0	0	
	合 計				4					43

(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24年度末				平成25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	733	—	34	34	1,090	—	10	10	
	外国株価指数先物									
買建	546	—	△0	△0	1,389	—	△18	△18		
合 計				34					△8	

(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24年度末および平成25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	保険負債	138,800	138,800	12,272
	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	50,861	45,671	2,322
	固定金利受取/変動金利支払				
合 計					14,595

(単位:百万円)

ヘッジ会計の方法	種類	主なヘッジ対象	平成25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	187,900	187,900	9,145
	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	47,633	43,533	1,911
	固定金利受取/変動金利支払				
合 計					11,056

【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	5,190	18,080	22,000	5,591	12,100	126,700	189,661
	平均受取金利	1.78	1.67	1.90	2.09	1.62	1.96	1.90
	平均支払金利	0.39	0.44	0.42	0.49	0.27	0.27	0.31

(単位:百万円、%)

区 分		平成25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	4,100	15,987	27,000	545	12,100	175,800	235,533
	平均受取金利	1.87	1.62	1.95	1.60	1.62	1.92	1.89
	平均支払金利	0.41	0.36	0.40	0.31	0.22	0.23	0.26

○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24年度末			平成25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						
	売建		1,651,256	—	△107,936	2,012,522	—	11,844
	米ドル		1,508,739	—	△101,766	1,736,832	—	15,119
	その他		142,516	—	△6,169	275,689	—	△3,275
繰延ヘッジ	通貨スワップ	外貨建債券						
	ユーロ		9,208	9,208	158	26,958	26,958	107
合計					△107,777			11,952

○株式関連

平成24年度末および平成25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24年度末および平成25年度第2四半期(上半期)末とも保有していません。