

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25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	12,099	△43,562	—	—	—	△31,462
ヘッジ会計非適用分	366	2	41	—	—	411
合 計	12,466	△43,559	41	—	—	△31,051

(単位:百万円)

区 分	平成26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	21,110	△103,474	—	—	—	△82,363
ヘッジ会計非適用分	—	68	4	—	—	73
合 計	21,110	△103,405	4	—	—	△82,289

(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25年度末:通貨関連△40,632百万円、平成26年度第2四半期(上半期)末:通貨関連△99,351百万円)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25年度末				平成26年度第2四半期(上半期)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		
	金利スワップ 固定金利受取/変動金利支払	47,600	47,600	366	366	—	—	—	—
	合 計				366				—

(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25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	—	—	—	—	—	47,600	47,600
	平均受取金利	—	—	—	—	—	1.80	1.80
	平均支払金利	—	—	—	—	—	0.21	0.21

(単位:百万円、%)

区 分		平成26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25年度末				平成26年度第2四半期(上半期)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	888	—	△3	△3	2,889	—	△2	△2	
	米ドル	277	—	△1	△1	1,495	—	△6	△6	
	ユーロ	242	—	△0	△0	1,040	—	2	2	
	豪ドル	319	—	△1	△1	316	—	1	1	
	その他	48	—	△0	△0	35	—	△0	△0	
	買建	1,165	—	6	6	6,307	—	71	71	
	米ドル	643	—	3	3	3,845	—	67	67	
	ユーロ	490	—	2	2	1,973	—	3	3	
	その他	32	—	0	0	488	—	0	0	
合 計				2					68	

(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25年度末				平成26年度第2四半期(上半期)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									
	売建	—	—	—	—	7,602	—	△11	△11	
	買建	6,194	—	24	24	1,840	—	29	29	
	外国株価指数先物									
買建	687	—	16	16	2,792	—	△13	△13		
合 計				41					4	

(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25年度末および平成26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25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	186,800	186,800	10,358
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	47,695	45,020	1,740
合 計					12,099

(単位:百万円)

ヘッジ会計の方法	種類	主なヘッジ対象	平成26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	234,100	234,100	19,598
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	47,040	41,402	1,512
合 計					21,110

【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25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	2,675	25,220	17,000	4,600	12,100	172,900	234,495
変動金利支払	平均受取金利	1.92	1.75	1.94	1.51	1.70	1.92	1.88
スワップ	平均支払金利	0.47	0.34	0.35	0.20	0.20	0.20	0.23

(単位:百万円、%)

区 分		平成26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	5,637	30,165	7,454	4,100	13,283	220,500	281,140
変動金利支払	平均受取金利	1.42	1.86	1.98	1.50	1.52	1.89	1.86
スワップ	平均支払金利	0.29	0.33	0.37	0.18	0.16	0.18	0.20

○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25年度末			平成26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	外貨建 債券	2,031,158	—	△40,632	2,147,793	—	△99,351
	米ドル		1,690,459	—	△33,578	1,807,192	—	△97,628
	ユーロ		201,159	—	△1,789	197,486	—	△586
	豪ドル		139,540	—	△5,264	143,113	—	△1,137
繰延ヘッジ	通貨スワップ ユーロ	外貨建 債券	26,958	26,958	△2,929	31,179	31,179	△4,122
合 計					△43,562			△103,474

(注) 為替予約等が付されていることにより、決済時における円貨額が確定し、貸借対照表において当該円貨額で表示されている外貨建金銭債権債務等にかかる取引を除いています。

○株式関連

平成25年度末および平成26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25年度末および平成26年度第2四半期(上半期)末とも保有していません。