

#### 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26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	32,813	△75,719	—	—	—	△42,905
ヘッジ会計非適用分	10	△16	△21	—	—	△27
合 計	32,824	△75,735	△21	—	—	△42,933

(単位:百万円)

区 分	平成27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	32,253	26,004	—	—	—	58,257
ヘッジ会計非適用分	—	△68	△489	—	—	△558
合 計	32,253	25,935	△489	—	—	57,699

(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26年度末:通貨関連△70,919百万円、平成27年度第2四半期(上半期)末:通貨関連37,156百万円)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26年度末				平成27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	1,000	1,000	10	10	—	—	—	—
	合 計				10				—

(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26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	—	—	—	—	—	1,000	1,000
	平均受取金利	—	—	—	—	—	1.17	1.17
	平均支払金利	—	—	—	—	—	0.14	0.14

(単位:百万円、%)

区 分		平成27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26年度末				平成27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	11,566	—	△46	△46	5,615	—	△65	△65
	豪ドル	888	—	3	3	4,390	—	△67	△67
	米ドル	8,654	—	△53	△53	1,143	—	1	1
	ユーロ	977	—	7	7	61	—	0	0
	カナダドル	672	—	△1	△1	9	—	△0	△0
	その他	373	—	△1	△1	9	—	0	0
	買建	11,641	—	30	30	8,444	—	△3	△3
	米ドル	8,933	—	44	44	7,914	—	△1	△1
	ユーロ	1,428	—	△13	△13	510	—	△1	△1
	カナダドル	567	—	1	1	—	—	—	—
	豪ドル	490	—	△2	△2	—	—	—	—
	その他	220	—	0	0	20	—	△0	△0
	合 計				△16				△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26年度末				平成27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	1,059	—	△25	△25	15,679	—	△449	△449
	外国株価指数先物								
買建	1,681	—	3	3	1,413	—	△40	△40	
合 計				△21				△489	

(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26年度末および平成27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26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	234,100	234,100	31,576
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	46,251	31,141	1,237
合 計					32,813

(単位:百万円)

ヘッジ会計の方法	種類	主なヘッジ対象	平成27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	233,900	233,900	31,259
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	40,099	30,044	993
合 計					32,253

## 【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26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	15,110	22,000	5,409	7,800	13,832	216,200	280,351
変動金利支払	平均受取金利	1.62	1.90	2.11	1.56	1.73	1.89	1.86
スワップ	平均支払金利	0.25	0.31	0.34	0.14	0.21	0.14	0.17

(単位:百万円、%)

区 分		平成27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	10,055	26,000	363	7,500	13,181	216,900	273,999
変動金利支払	平均受取金利	1.72	1.95	1.60	1.56	1.73	1.89	1.87
スワップ	平均支払金利	0.24	0.31	0.21	0.13	0.20	0.14	0.16

## ○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26年度末			平成27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	2,354,756	—	△70,919	2,295,978	—	37,156
	米ドル		2,010,069	—	△89,973	1,961,914	—	21,621
	ユーロ		196,339	—	10,404	192,061	—	688
	豪ドル		148,347	—	8,649	142,003	—	14,846
繰延ヘッジ	為替予約 買建	外国株式 予定取引	—	—	—	604,737	—	△7,617
	米ドル		—	—	—	604,737	—	△7,617
	通貨スワップ ユーロ	外貨建 債券	35,575	35,575	△4,800	35,575	35,575	△3,534
合 計					△75,719			26,004

(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26年度末および平成27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26年度末および平成27年度第2四半期(上半期)末とも保有していません。