

5. デリバティブ取引の時価情報（一般勘定）（ヘッジ会計適用・非適用分の合算値）

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15年度上半期末						平成16年度上半期末					
	金利関連	通貨関連	株式関連	債券関連	その他	合計	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	1,198	103,079	-	-	-	104,278	1,703	46,923	-	-	-	45,219
ヘッジ会計非適用分	2,354	5,519	734	7	25	7,158	881	3,904	-	112	18	3,117
合 計	3,553	108,599	734	7	25	111,436	2,584	50,827	-	112	18	48,336

区 分	平成15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	1,332	100,245	-	-	-	101,578
ヘッジ会計非適用分	1,270	4,835	-	219	22	5,909
合 計	2,602	105,080	-	219	22	107,487

（注）上表のうち損益計算書に計上されている金額は以下のとおりです。

平成15年度上半期末：ヘッジ会計適用分のうち時価ヘッジ適用分の差損益（通貨関連103,079百万円）及びヘッジ会計非適用分のうちヘッジ会計の中止に伴う繰延ヘッジ損益の未償却額を除いた差損益（7,158百万円）の合計110,238百万円

平成16年度上半期末：ヘッジ会計適用分のうち時価ヘッジ適用分の差損益（通貨関連 46,923百万円）及びヘッジ会計非適用分のうちヘッジ会計の中止に伴う繰延ヘッジ損益の未償却額を除いた差損益（ 3,117百万円）の合計 50,040百万円

平成15年度末：ヘッジ会計適用分のうち時価ヘッジ適用分の差損益（通貨関連100,245百万円）及びヘッジ会計非適用分のうちヘッジ会計の中止に伴う繰延ヘッジ損益の未償却額を除いた差損益（5,909百万円）の合計106,154百万円

時価情報

（a）金利関連

（単位：百万円）

区 分	種 類	平成15年度上半期末					平成16年度上半期末					平成15年度末				
		契約額等		時価	差損益	うちヘッジ会計適用分	契約額等		時価	差損益	うちヘッジ会計適用分	契約額等		時価	差損益	うちヘッジ会計適用分
		うち1年超					うち1年超					うち1年超				
取引所	金利先物 売建	-	-	-	-	-	16,449	11,461	16,455	6	-	-	-	-	-	-
店頭	金利スワップ 固定金利受取 / 変動金利支払	445,456	403,178	3,927	3,927	1,198	282,682	184,997	2,925	2,925	1,703	244,708	217,537	3,073	3,073	1,332
	固定金利支払 / 変動金利受取	202,400	66,800	374	374	-	81,800	15,000	334	334	-	217,400	81,800	471	471	-
	合 計				3,553	1,198				2,584	1,703				2,602	1,332

（注）差損益欄には、先物取引については契約額と時価との差額を記載し、スワップ取引については時価を記載しています。

（参考）金利スワップ残存期間別残高

（単位：百万円、%）

区 分	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
	平成15年度上半期末						
受取側固定スワップ想定元本	42,278	263,940	127,730	4,000	3,500	4,008	445,456
平均受取固定金利	1.61	1.04	0.62	0.70	0.60	1.41	0.97
平均支払変動金利	0.07	0.07	0.07	0.07	0.07	0.07	0.07
支払側固定スワップ想定元本	135,600	66,800	-	-	-	-	202,400
平均支払固定金利	0.25	0.36	-	-	-	-	0.29
平均受取変動金利	0.07	0.07	-	-	-	-	0.07
合 計	177,878	330,740	127,730	4,000	3,500	4,008	647,856
平成16年度上半期末							
受取側固定スワップ想定元本	97,685	78,047	81,150	12,600	9,500	3,699	282,682
平均受取固定金利	1.76	0.64	0.71	1.03	1.13	1.41	1.09
平均支払変動金利	0.06	0.06	0.06	0.06	0.06	0.06	0.06
支払側固定スワップ想定元本	66,800	-	15,000	-	-	-	81,800
平均支払固定金利	0.36	-	0.62	-	-	-	0.41
平均受取変動金利	0.06	-	0.06	-	-	-	0.06
合 計	164,485	78,047	96,150	12,600	9,500	3,699	364,482
平成15年度末							
受取側固定スワップ想定元本	27,171	135,850	66,933	7,400	3,500	3,853	244,708
平均受取固定金利	0.99	1.53	0.53	0.83	0.60	1.41	1.16
平均支払変動金利	0.06	0.06	0.07	0.06	0.07	0.06	0.06
支払側固定スワップ想定元本	135,600	66,800	15,000	-	-	-	217,400
平均支払固定金利	0.25	0.36	0.62	-	-	-	0.31
平均受取変動金利	0.07	0.07	0.07	-	-	-	0.07
合 計	162,771	202,650	81,933	7,400	3,500	3,853	462,108

(d) 債券関連

(単位:百万円)

区分	種類	平成15年度上半期末				平成16年度上半期末				平成15年度末			
		契約額等	時価	差損益	うちヘッジ会計適用分	契約額等	時価	差損益	うちヘッジ会計適用分	契約額等	時価	差損益	うちヘッジ会計適用分
取引所	円建債券先物												
	売建	2,073	2,054	19	-	1,797	1,793	3	-	-	-	-	-
	買建	4,507	4,520	12	-	1,779	1,793	14	-	20,222	20,219	3	-
	外貨建債券先物												
店頭	売建	-	-	-	-	28,830	28,880	50	-	101,937	102,491	553	-
	買建	-	-	-	-	49,401	49,318	83	-	119,053	119,391	337	-
店頭	債券店頭オプション												
	売建												
	コール	4,220				-				-			
	(66)	(66)	65	0	-	(-)				(-)			
	プット	28,416				16,505				-			
	(410)	(410)	598	188	-	(55)	52	2	-	(-)			
	買建												
	コール	13,247				16,505				-			
	(149)	(149)	135	13	-	(3)	3	0	-	(-)			
	プット	4,220				-				-			
(80)	(80)	59	20	-	(-)				(-)				
外貨建債券店頭オプション													
買建													
コール	44,131				-				-				
(152)	(152)	335	182	-	(-)				(-)				
合計				7				112				219	

- (注) 1.括弧内には、貸借対照表に計上したオプション料を記載しています。
2.差損益欄には、先物取引については契約額と時価との差額を記載し、オプション取引についてはオプション料と時価との差額を記載しています。
3.上表において、残存期間1年超の取引はありません。

(e) その他

(単位:百万円)

区分	種類	平成15年度上半期末				平成16年度上半期末				平成15年度末			
		契約額等	時価	差損益	うちヘッジ会計適用分	契約額等	時価	差損益	うちヘッジ会計適用分	契約額等	時価	差損益	うちヘッジ会計適用分
店頭	クレジット・フォルト・スワップ												
	オプション売建	1,000	25	25	-	1,000	18	18	-	1,000	22	22	-
合計		1,000	25	25	-	1,000	18	18	-	1,000	22	22	-

- (注) 1.差損益欄には、時価を記載しています。
2.上表は、全て残存期間1年超の取引です。