

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16年度上半期末						平成17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	1,703	46,923	-	-	-	45,219	336	72,914	-	-	-	72,577
ヘッジ会計非適用分	881	3,904	-	112	18	3,117	95	4,967	-	28	11	4,889
合 計	2,584	50,827	-	112	18	48,336	431	77,882	-	28	11	77,467

区 分	平成16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	2,020	83,787	-	-	-	81,766
ヘッジ会計非適用分	488	2,871	-	67	15	2,299
合 計	2,509	86,658	-	67	15	84,066

（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17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 72,914百万円）及びヘッジ会計非適用分の差損益（4,889百万円）の合計 77,803百万円

平成16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 83,787百万円）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（2,299百万円）の合計 86,087百万円

時価情報

（a）金利関連

（単位：百万円）

区 分	種 類	平成16年度上半期末					平成17年度上半期末					平成16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	282,682	184,997	2,925	2,925	1,703	226,614	178,594	426	426	336	263,455	152,905	2,608	2,608	2,020
	固定金利支払/変動金利受取	81,800	15,000	334	334	-	2,000	2,000	4	4	-	66,800	-	98	98	-
	合 計				2,584	1,703				431	336			2,509	2,020	

（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17年度上半期末							
受取側固定スワップ想定元本	48,020	46,263	73,340	31,900	23,700	3,391	226,614
平均受取固定金利	0.78	0.45	0.75	1.10	1.03	1.41	0.78
平均支払変動金利	0.06	0.06	0.06	0.06	0.06	0.07	0.06
支払側固定スワップ想定元本	-	-	2,000	-	-	-	2,000
平均支払固定金利	-	-	0.07	-	-	-	0.07
平均受取変動金利	-	-	0.59	-	-	-	0.59
合 計	48,020	46,263	75,340	31,900	23,700	3,391	228,614
平成16年度末							
受取側固定スワップ想定元本	110,550	52,600	71,660	20,900	4,200	3,545	263,455
平均受取固定金利	1.77	0.39	0.76	1.13	0.76	1.41	1.15
平均支払変動金利	0.06	0.06	0.06	0.07	0.07	0.06	0.06
支払側固定スワップ想定元本	66,800	-	-	-	-	-	66,800
平均支払固定金利	0.36	-	-	-	-	-	0.36
平均受取変動金利	0.07	-	-	-	-	-	0.07
合 計	177,350	52,600	71,660	20,900	4,200	3,545	330,255

(b) 通貨関連

(単位：百万円)

区分	種類	平成16年度上半期末				平成17年度上半期末				平成16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	為替予約												
	売建	3,073,689	3,125,245	51,555	46,941	3,090,750	3,161,030	70,280	68,460	3,063,730	3,149,889	86,158	83,796
	(米ドル)	1,553,480	1,573,678	20,198	19,113	1,684,281	1,728,198	43,917	41,148	1,604,687	1,646,384	41,697	39,908
	(ユーロ)	1,251,820	1,278,255	26,434	23,294	1,011,241	1,029,707	18,466	19,218	1,213,304	1,245,738	32,434	32,286
	(英ポンド)	169,786	170,940	1,154	1,017	291,954	296,796	4,841	5,387	139,504	147,849	8,344	8,088
	(加ドル)	43,264	45,038	1,773	1,707	60,265	62,191	1,925	1,717	52,929	55,272	2,343	2,200
	(スウェーデンクローネ)	44,504	46,188	1,684	1,506	33,856	34,859	1,002	867	44,291	45,545	1,253	1,227
	(豪ドル)	10,833	11,143	310	301	9,150	9,277	127	120	9,012	9,097	85	83
	買建	192,493	193,423	929	17	406,762	405,362	1,400	1,359	187,858	187,663	195	8
	(米ドル)	37,167	37,252	85	0	216,040	217,719	1,679	1,359	77,309	77,628	319	8
	(ユーロ)	127,868	128,675	807	17	141,578	138,998	2,580	-	101,977	101,349	627	0
	(英ポンド)	25,076	25,114	37	-	43,442	42,496	946	-	3,245	3,292	46	-
	(中国元)	-	-	-	-	5,153	5,596	442	-	5,125	5,188	62	-
	(スウェーデンクローネ)	-	-	-	-	354	354	0	-	-	-	-	-
	(香港ドル)	-	-	-	-	174	178	4	-	93	95	2	-
	(シンガポールドル)	-	-	-	-	19	19	0	-	-	-	-	-
	(豪ドル)	2,380	2,380	-	-	-	-	-	-	107	109	1	-
	通貨オプション												
	売建												
	コール	-	-	-	-	306,025	-	-	-	-	-	-	-
(米ドル)	(-)	-	-	-	(4,022)	6,994	2,972	2,972	(-)	-	-	-	
	(-)	-	-	-	(4,022)	6,994	2,972	2,972	(-)	-	-	-	
買建													
コール	-	-	-	-	3,395	-	-	-	-	-	-	-	
(米ドル)	(-)	-	-	-	(5)	3	1	-	(-)	-	-	-	
	(-)	-	-	-	(5)	3	1	-	(-)	-	-	-	
プット	100,665	-	-	-	497,583	-	-	-	306,123	-	-	-	
(米ドル)	(205)	3	202	-	(5,002)	1,774	3,227	2,840	(309)	4	305	-	
	64,075	-	-	-	336,133	-	-	-	196,416	-	-	-	
(ユーロ)	(130)	2	127	-	(4,640)	1,774	2,866	2,840	(234)	2	232	-	
	36,589	0	74	-	161,450	-	-	-	109,707	-	-	-	
	(74)	-	-	-	(362)	0	361	-	(75)	2	73	-	
合計			50,827	46,923			77,882	72,914			86,658	83,787	

- (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. 各期末の為替相場は先物相場を使用しています。
3. 為替予約等により決済時における円貨額が確定しており、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係る当該為替予約等は、開示の対象より除いています。
4. 差損益欄には、先渡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。
5. 上表において、残存期間1年超の取引はありません。

(c) 株式関連は平成16年度上半期末以降期末残高がないため、記載していません。

(d) 債券関連

(単位: 百万円)

区分	種類	平成16年度上半期末				平成17年度上半期末				平成16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	1,797	1,793	3	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	買建	1,779	1,793	14	-	13,819	13,765	54	-	2,201	2,230	29	-
	外貨建債券先物												
	売建	28,830	28,880	50	-	47,091	46,532	559	-	60,748	60,533	215	-
	買建	49,401	49,318	83	-	46,079	45,669	409	-	23,016	22,951	65	-
店頭	外貨建債券先渡契約												
	売建	-	-	-	-	22,973	22,814	158	-	21,826	21,736	90	-
	買建	-	-	-	-	61,783	61,512	270	-	59,333	59,125	207	-
	債券店頭オプション												
	売建												
	コール	-	-	-	-	1,009	-	-	-	-	-	-	-
	プット	(-)	-	-	-	(4)	4	0	-	(-)	-	-	-
	買建	16,505	16,505	0	-	5,209	5,209	0	-	2,099	2,099	0	-
	コール	(55)	52	2	-	(10)	19	9	-	(7)	2	5	-
	プット	16,505	16,505	0	-	5,209	5,209	0	-	2,099	2,099	0	-
買建	(3)	3	0	-	(1)	-	1	-	(1)	1	0	-	
コール	-	-	-	-	1,009	-	-	-	-	-	-	-	
プット	(-)	-	-	-	(5)	4	0	-	(-)	-	-	-	
合計			112	-			28	-			67	-	

- (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、先物取引および先渡契約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16年度上半期末				平成17年度上半期末				平成16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	18	18	-	1,000	11	11	-	1,000	15	15	-
合計		1,000	18	18	-	1,000	11	11	-	1,000	15	15	-

- (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。