

## 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17年度上半期末						平成18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	336	72,914	-	-	-	72,577	1,062	33,497	-	-	-	34,559
ヘッジ会計非適用分	95	4,967	-	28	11	4,889	2	11,877	-	283	4	11,591
合 計	431	77,882	-	28	11	77,467	1,064	45,375	-	283	4	46,151

区 分	平成17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	3,681	29,507	-	-	-	33,189
ヘッジ会計非適用分	28	2,814	-	51	13	2,881
合 計	3,710	32,322	-	51	13	36,070

（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18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 33,497百万円）及びヘッジ会計非適用分の差損益（11,591百万円）の合計 45,089百万円

平成17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 29,507百万円）及びヘッジ会計非適用分の差損益（2,881百万円）の合計 32,389百万円

### 時価情報

（a）金利関連

（単位：百万円）

区 分	種 類	平成17年度上半期末					平成18年度上半期末					平成17年度末				
		契約額等	うち1年超	時価	差損益	うちヘッジ会計適用分	契約額等	うち1年超	時価	差損益	うちヘッジ会計適用分	契約額等	うち1年超	時価	差損益	うちヘッジ会計適用分
取 引 所	金利先物 売建	-	-	-	-	-	4,975	-	4,974	1	-	4,978	-	4,976	2	-
	買建	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	4,968	-	4,963	4	-
店 頭	金利スワップ 固定金利受取 / 変動金利支払	226,614	178,594	426	426	336	226,228	195,048	1,054	1,054	1,062	220,557	193,657	3,708	3,708	3,681
	固定金利支払 / 変動金利受取	2,000	2,000	4	4	-	5,000	5,000	11	11	-	-	-	-	-	-
合 計					431	336				1,064	1,062			3,710	3,681	

（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
	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18年度上半期末	受取側固定スワップ想定元本	31,180	73,405	43,670	53,200	24,773	-	226,228
	平均受取固定金利	0.43	0.74	0.83	1.14	1.66	-	0.91
	平均支払変動金利	0.41	0.42	0.42	0.39	0.44	-	0.41
	支払側固定スワップ想定元本	-	5,000	-	-	-	-	5,000
	平均支払固定金利	-	0.46	-	-	-	-	0.46
	平均受取変動金利	-	0.86	-	-	-	-	0.86
	合 計	31,180	78,405	43,670	53,200	24,773	-	231,228
平成17年度末	受取側固定スワップ想定元本	26,900	55,860	67,010	33,000	34,550	3,237	220,557
	平均受取固定金利	0.44	0.54	0.82	1.14	1.18	1.41	0.81
	平均支払変動金利	0.09	0.10	0.10	0.10	0.08	0.09	0.10
	支払側固定スワップ想定元本	-	-	-	-	-	-	-
	平均支払固定金利	-	-	-	-	-	-	-
	平均受取変動金利	-	-	-	-	-	-	-
	合 計	26,900	55,860	67,010	33,000	34,550	3,237	220,557

## (b) 通貨関連

(単位: 百万円)

区分	種類	平成17年度上半期末				平成18年度上半期末				平成17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	3,090,750	3,161,030	70,280	68,460	2,346,583	2,382,303	35,720	33,519	2,787,814	2,822,617	34,803	29,510
	(米ドル)	1,684,281	1,728,198	43,917	41,148	1,287,007	1,297,118	10,111	8,475	1,400,354	1,400,335	18	262
	(ユーロ)	1,011,241	1,029,707	18,466	19,218	826,569	842,111	15,541	15,322	1,053,995	1,084,829	30,834	25,921
	(英ポンド)	291,954	296,796	4,841	5,387	172,707	181,838	9,131	8,865	224,119	228,566	4,446	4,158
	(加ドル)	60,265	62,191	1,925	1,717	36,112	36,618	505	467	58,066	57,214	851	807
	(スイーデンクローナ)	33,856	34,859	1,002	867	17,737	18,212	474	427	31,110	31,924	814	730
	(豪ドル)	9,150	9,277	127	120	6,449	6,405	44	38	20,038	19,616	421	230
	(香港ドル)	-	-	-	-	-	-	-	-	129	129	0	-
	買建	406,762	405,362	1,400	1,359	475,590	476,991	1,401	21	382,790	385,271	2,480	2
	(米ドル)	216,040	217,719	1,679	1,359	289,632	290,550	917	-	174,740	174,708	32	0
	(ユーロ)	141,578	138,998	2,580	-	172,382	171,927	455	21	165,261	167,248	1,987	2
	(英ポンド)	43,442	42,496	946	-	5,664	5,787	122	0	26,063	26,087	23	-
	(中国元)	5,153	5,596	442	-	5,160	5,972	811	-	5,174	5,852	677	-
	(加ドル)	-	-	-	-	1,467	1,468	0	0	-	-	-	-
	(豪ドル)	-	-	-	-	888	884	3	-	11,098	10,926	171	-
	(スイーデンクローナ)	354	354	0	-	334	340	6	-	331	328	3	-
	(香港ドル)	174	178	4	-	59	60	1	-	121	120	0	-
	(シンガポールドル)	19	19	0	-	1	1	0	-	-	-	-	-
	通貨オプション												
	売建												
	コール	306,025				309,369				-			
	(米ドル)	(4,022)	6,994	2,972	2,972	(4,404)	7,908	3,504	-	(-)	-	-	-
	買建												
	コール	3,395				-				-			
	(米ドル)	(5)	3	1	-	(-)	-	-	-	(-)	-	-	-
プット	497,583				309,369				-				
(米ドル)	(5,002)	1,774	3,227	2,840	(8,144)	592	7,552	-	(-)	-	-	-	
(ユーロ)	161,450				-				-				
	(362)	0	361	-	(-)	-	-	-	(-)	-	-	-	
合計			77,882	72,914			45,375	33,497			32,322	29,507	

(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

平成17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17年度上半期末				平成18年度上半期末				平成17年度末			
		契約額等	時価	差損益	うちMMF会計適用分	契約額等	時価	差損益	うちMMF会計適用分	契約額等	時価	差損益	うちMMF会計適用分
取引所	円建債券先物 買建	13,819	13,765	54	-	14,948	14,962	14	-	7,947	7,874	73	-
	外貨建債券先物 売建	47,091	46,532	559	-	118,606	118,989	383	-	103,535	103,211	323	-
	買建	46,079	45,669	409	-	150,868	151,362	494	-	30,352	30,259	92	-
店頭	円建債券先物オプション 買建	-	-	-	-	2,720	3	0	-	-	-	-	-
	コール	(-)	-	-	-	(3)	3	0	-	(-)	-	-	-
店頭	外貨建債券先渡契約 売建	22,973	22,814	158	-	-	-	-	-	11,761	11,745	16	-
	買建	61,783	61,512	270	-	51,439	51,594	155	-	51,588	51,504	83	-
	債券店頭オプション 売建	-	-	-	-	2,552	1	2	-	(-)	-	-	-
	コール	1,009	4	0	-	(3)	1	2	-	(-)	-	-	-
	ブット	5,209	19	9	-	14,301	106	18	-	23,493	347	118	-
	買建	(10)	19	9	-	(125)	106	18	-	(228)	347	118	-
	コール	5,209	-	1	-	19,395	7	19	-	23,493	5	24	-
	ブット	(1)	-	1	-	(27)	7	19	-	(29)	5	24	-
	ブット	1,009	4	0	-	2,552	5	1	-	-	-	-	-
		(5)	4	0	-	(4)	5	1	-	(-)	-	-	-
合計				28	-			283	-			51	-

- (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17年度上半期末				平成18年度上半期末				平成17年度末			
		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	契約額等	うち1年超	時価	差損益
店頭	クレジットデフォルトスワップ オプション売建	1,000	1,000	11	11	3,000	2,000	5	5	5,000	4,000	9	9
	オプション買建	-	-	-	-	6,000	6,000	0	0	4,000	4,000	4	4
	合計	1,000	1,000	11	11	9,000	8,000	4	4	9,000	8,000	13	13

- (注) 差損益欄には、時価を記載しています。