

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18年度上半期末						平成19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	1,062	33,497	-	-	-	34,559	1,227	15,667	-	-	-	16,894
ヘッジ会計非適用分	2	11,877	-	283	4	11,591	4	4,774	-	865	5	3,898
合 計	1,064	45,375	-	283	4	46,151	1,222	20,441	-	865	5	20,793

区 分	平成18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	1,017	22,930	-	-	-	23,948
ヘッジ会計非適用分	16	1,064	-	266	12	826
合 計	1,033	23,994	-	266	12	24,774

（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19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 15,667百万円）及びヘッジ会計非適用分の差損益（3,898百万円）の合計 19,565百万円

平成18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 22,930百万円）及びヘッジ会計非適用分の差損益（826百万円）の合計 23,757百万円

時価情報

（a）金利関連

（単位：百万円）

区 分	種 類	平成18年度上半期末					平成19年度上半期末					平成18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	4,975	-	4,974	1	-	85,041	-	85,037	4	-	7,448	-	7,448	0	-
	買建	-	-	-	-	-	12,383	-	12,383	-	-	-	-	-	-	-
店 頭	金利スワップ 固定金利受取 / 変動金利支払	226,228	195,048	1,054	1,054	1,062	209,569	191,219	1,244	1,244	1,227	219,028	191,478	1,033	1,033	1,017
	固定金利支払 / 変動金利受取	5,000	5,000	11	11	-	27,000	27,000	16	16	-	-	-	-	-	-
合 計					1,064	1,062				1,222	1,227			1,033	1,017	

（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年超	5年超	7年超	10年超	合計
		3年以下	5年以下	7年以下	10年以下		
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19年度上半期末	受取側固定スワップ想定元本	18,350	78,465	52,710	47,300	12,744	209,569
	平均受取固定金利	0.64	0.78	1.08	1.35	1.68	1.03
	平均支払変動金利	0.83	0.97	0.89	0.87	0.89	0.91
	支払側固定スワップ想定元本	-	27,000	-	-	-	27,000
	平均支払固定金利	-	1.09	-	-	-	1.09
	平均受取変動金利	-	1.01	-	-	-	1.01
合 計	18,350	105,465	52,710	47,300	12,744	236,569	
平成18年度末	受取側固定スワップ想定元本	27,550	71,640	46,180	55,700	17,958	219,028
	平均受取固定金利	0.36	0.76	0.98	1.20	1.75	0.95
	平均支払変動金利	0.62	0.66	0.63	0.62	0.62	0.63
	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	27,550	71,640	46,180	55,700	17,958	219,028	

(b) 通貨関連

(単位:百万円)

区分	種類	平成18年度上半期末				平成19年度上半期末				平成18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	2,346,583	2,382,303	35,720	33,519	2,692,975	2,717,273	24,297	15,708	2,016,690	2,041,513	24,822	22,934
	(米ドル)	1,287,007	1,297,118	10,111	8,475	1,391,501	1,405,946	14,444	13,504	1,042,768	1,055,561	12,793	12,425
	(ユーロ)	826,569	842,111	15,541	15,322	908,486	921,598	13,111	7,164	725,372	738,187	12,814	11,437
	(英ポンド)	172,707	181,838	9,131	8,865	313,410	307,686	5,723	6,694	191,271	189,373	1,897	1,967
	(加ドル)	36,112	36,618	505	467	35,774	37,724	1,949	1,873	32,332	33,327	995	922
	(豪ドル)	6,449	6,405	44	38	24,616	25,690	1,073	418	5,646	5,967	320	317
	(スウェーデンクローナ)	17,737	18,212	474	427	19,185	18,627	557	557	19,298	19,095	202	201
	買建	475,590	476,991	1,401	21	872,120	878,794	6,674	41	127,148	127,976	827	3
	(米ドル)	289,632	290,550	917	-	435,861	435,928	66	-	55,145	55,175	30	-
	(ユーロ)	172,382	171,927	455	21	268,690	273,734	5,043	37	57,592	58,268	676	3
	(英ポンド)	5,664	5,787	122	0	141,778	142,585	806	3	7,960	7,999	39	0
	(豪ドル)	888	884	3	-	18,704	19,394	689	-	-	-	-	-
	(中国元)	5,160	5,972	811	-	6,079	6,144	64	-	6,023	6,112	88	-
	(加ドル)	1,467	1,468	0	0	889	892	2	-	-	-	-	-
	(香港ドル)	59	60	1	-	115	115	0	-	131	130	0	-
	(スウェーデンクローナ)	334	340	6	-	-	-	-	-	293	286	6	-
	(シンガポールドル)	1	1	0	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	(タイバーツ)	-	-	-	-	-	-	-	-	2	2	0	-
	通貨オプション												
	売建												
	コール	309,369				298,740				-			
	(ユーロ)	(4,404)	7,908	3,504	-	(3,327)	4,566	1,238	-	(-)	-	-	-
	(米ドル)	(-)	-	-	-	153,413	4,132	2,261	-	(-)	-	-	-
	プット	309,369				145,326				-			
	(ユーロ)	(4,404)	7,908	3,504	-	(1,456)	434	1,022	-	(-)	-	-	-
	買建												
プット	309,369				298,740				-				
(ユーロ)	(8,144)	592	7,552	-	(5,268)	3,689	1,579	-	(-)	-	-	-	
(米ドル)	(-)	-	-	-	153,413	1,046	1,431	-	(-)	-	-	-	
コール	309,369				145,326				-				
(ユーロ)	(8,144)	592	7,552	-	(2,790)	2,642	147	-	(-)	-	-	-	
合計			45,375	33,497			20,441	15,667			23,994	22,930	

(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18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18年度上半期末				平成19年度上半期末				平成18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	-	-	-	-	62,506	62,207	299	-	1,339	1,341	2	-
	買建	14,948	14,962	14	-	19,235	19,161	73	-	8,450	8,451	1	-
	外貨建債券先物												
	売建	118,606	118,989	383	-	120,402	120,115	287	-	126,244	125,998	246	-
	買建	150,868	151,362	494	-	381,527	381,792	264	-	81,520	81,384	136	-
	円建債券先物オプション												
	買建												
	コール	2,720				-				-			
	プット	(3)	3	0	-	(-)				(-)			
店頭	外貨建債券先渡契約												
	売建	-	-	-	-	33,121	33,065	55	-	40,669	40,615	54	-
	買建	51,439	51,594	155	-	41,275	41,332	56	-	65,972	66,075	103	-
	債券店頭オプション												
	売建												
	コール	2,552				-				7,447			
	プット	(3)	1	2	-	(-)				(27)	21	5	-
	買建	14,301	106	18	-	4,016	5	1	-	-			
	コール	(125)				(3)				(-)			
	プット	19,395	7	19	-	44,478	110	22	-	5,066	3	4	-
プット	(27)				(132)				(8)				
プット	2,552	5	1	-	-				7,447	32	2	-	
プット	(4)				(-)				(34)				
合計			283	-			865	-			266	-	

- (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18年度上半期末				平成19年度上半期末				平成18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	契約額等	うち1年超	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	3,000	2,000	5	5	-	10,000	10,000	8	8	-	4,000	4,000	4	4	-
	オプション買建	6,000	6,000	0	0	-	8,000	8,000	2	2	-	6,000	6,000	16	16	-
合計				4	-				5	-				12	-	

- (注) 差損益欄には、時価を記載しています。