

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19年度第2四半期(上半期)末						平成20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	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	1,227	15,667	-	-	-	16,894	184	166,903	-	-	-	166,718
ヘッジ会計非適用分	4	4,774	-	865	5	3,898	6	30,613	-	434	29	31,026
合 計	1,222	20,441	-	865	5	20,793	177	197,516	-	434	29	197,744

区 分	平成19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	1,307	20,348	-	-	-	21,655
ヘッジ会計非適用分	39	2,594	-	259	2	2,890
合 計	1,347	22,942	-	259	2	24,546

（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19年度第2四半期(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20年度第2四半期(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166,903百万円）及びヘッジ会計非適用分の差損益（31,026百万円）の合計197,929百万円

平成19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20,348百万円）及びヘッジ会計非適用分の差損益（2,890百万円）の合計23,238百万円

時価情報

(a) 金利関連

（単位：百万円）

区 分	種 類	平成19年度第2四半期(上半期)末					平成20年度第2四半期(上半期)末					平成19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	85,041	-	85,037	4	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	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	209,569	191,219	1,244	1,244	1,227	193,446	139,181	188	188	184	236,870	200,910	1,401	1,401	1,307
	固定金利支払 / 変動金利受取	27,000	27,000	16	16	-	15,000	-	10	10	-	25,000	25,000	53	53	-
合 計				1,222	1,227				177	184				1,347	1,307	

（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	3年以下	5年以下	7年以下	10年以下		
平成19年度第2四半期(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20年度第2四半期(上半期)末	受取側固定スワップ想定元本	54,265	35,050	55,000	29,900	19,231	-	193,446
	平均受取固定金利	0.82	0.84	1.17	1.59	1.52	-	1.11
	平均支払変動金利	0.96	0.97	0.95	0.95	0.97	-	0.96
	支払側固定スワップ想定元本	15,000	-	-	-	-	-	15,000
	平均支払固定金利	1.08	-	-	-	-	-	1.08
	平均受取変動金利	0.98	-	-	-	-	-	0.98
合 計		69,265	35,050	55,000	29,900	19,231	-	208,446
平成19年度末	受取側固定スワップ想定元本	35,960	91,180	41,000	49,900	18,830	-	236,870
	平均受取固定金利	0.71	0.90	1.23	1.34	1.54	-	1.07
	平均支払変動金利	0.97	1.01	0.97	0.95	0.96	-	0.98
	支払側固定スワップ想定元本	-	25,000	-	-	-	-	25,000
	平均支払固定金利	-	1.07	-	-	-	-	1.07
	平均受取変動金利	-	0.98	-	-	-	-	0.98
合 計		35,960	116,180	41,000	49,900	18,830	-	261,870

(b) 通貨関連

(単位: 百万円)

区分	種類	平成19年度第2四半期(上半期)末				平成20年度第2四半期(上半期)末				平成19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	為替予約												
	売建	2,692,975	2,717,273	24,297	15,708	3,094,700	2,905,295	189,405	167,334	2,349,061	2,330,640	18,421	20,337
	(米ドル)	1,391,501	1,405,946	14,444	13,504	1,650,500	1,587,302	63,198	53,720	1,172,217	1,158,003	14,213	12,099
	(ユーロ)	908,486	921,598	13,111	7,164	1,062,056	969,849	92,207	84,291	887,378	892,435	5,057	1,177
	(英ポンド)	313,410	307,686	5,723	6,694	251,339	228,070	23,268	20,871	221,400	214,152	7,247	7,555
	(加ドル)	35,774	37,724	1,949	1,873	53,926	51,756	2,170	1,237	34,421	32,369	2,051	1,930
	(豪ドル)	24,616	25,690	1,073	418	46,474	41,646	4,827	3,765	11,986	11,719	267	210
	(スウェーデンクローナ)	19,185	18,627	557	557	14,974	12,997	1,977	1,837	18,284	18,567	283	279
	(デノマーククローネ)	-	-	-	-	10,344	9,247	1,097	994	24	24	0	-
	(ルウェーグクローネ)	-	-	-	-	4,666	4,009	656	616	45	45	0	-
	(台湾ドル)	-	-	-	-	414	413	1	-	-	-	-	-
	(香港ドル)	-	-	-	-	2	2	0	-	3,015	3,032	17	-
	(スイスフラン)	-	-	-	-	-	-	-	-	287	288	0	-
	買建	872,120	878,794	6,674	41	393,828	383,747	10,080	431	316,060	320,582	4,521	10
	(米ドル)	435,861	435,928	66	-	181,450	179,162	2,288	167	136,260	136,726	465	7
	(ユーロ)	268,690	273,734	5,043	37	124,186	120,269	3,916	209	135,870	139,953	4,083	2
	(英ポンド)	141,778	142,585	806	3	48,558	46,428	2,129	17	31,384	31,808	424	-
	(豪ドル)	18,704	19,394	689	-	27,042	25,904	1,137	-	6,083	6,137	53	-
	(中国元)	6,079	6,144	64	-	6,535	6,052	483	-	6,227	5,716	511	-
	(加ドル)	889	892	2	-	4,783	4,779	3	-	-	-	-	-
	(デノマーククローネ)	-	-	-	-	780	699	81	21	-	-	-	-
	(ルウェーグクローネ)	-	-	-	-	320	276	44	14	-	-	-	-
	(香港ドル)	115	115	0	-	83	89	5	-	167	171	4	-
	(スイスフラン)	-	-	-	-	64	64	0	-	-	-	-	-
	(トルコリラ)	-	-	-	-	21	20	0	-	-	-	-	-
	(スウェーデンクローナ)	-	-	-	-	-	-	-	-	66	67	1	-
	通貨オプション												
売建													
コール	298,740				324,681				-				
(3,327)	4,566	1,238	-	(7,732)	3,564	4,168	-	(-)	-	-	-		
(米ドル)	145,326				169,658				-				
(1,456)	434	1,022	-	(4,466)	3,140	1,326	-	(-)	-	-	-		
(ユーロ)	153,413				155,023				-				
(1,870)	4,132	2,261	-	(3,266)	424	2,841	-	(-)	-	-	-		
買建													
プット	298,740				324,681				-				
(5,268)	3,689	1,579	-	(11,972)	25,995	14,023	-	(-)	-	-	-		
(米ドル)	145,326				169,658				-				
(2,790)	2,642	147	-	(5,639)	6,233	593	-	(-)	-	-	-		
(ユーロ)	153,413				155,023				-				
(2,478)	1,046	1,431	-	(6,332)	19,762	13,430	-	(-)	-	-	-		
合計			20,441	15,667			197,516	166,903			22,942	20,348	

- (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19年度第2四半期(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19年度第2四半期(上半期)末				平成20年度第2四半期(上半期)末				平成19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	-	42,456	42,362	93	-	54,079	54,100	20	-
	買建	19,235	19,161	73	-	685	687	1	-	7,900	8,009	109	-
	外貨建債券先物												
	売建	120,402	120,115	287	-	73,080	73,216	136	-	73,226	73,779	553	-
買建	381,527	381,792	264	-	233,363	234,155	792	-	119,831	120,745	914	-	
所	円建債券先物オプション												
	買建												
	ブット	6,700			-	-			-	-			-
		(13)	13	0	-	(-)	-	-	-	(-)	-	-	-
店頭	外貨建債券先渡契約												
	売建	33,121	33,065	55	-	-	-	-	-	19,579	19,903	324	-
	買建	41,275	41,332	56	-	42,850	42,643	207	-	41,547	41,721	174	-
	債券店頭オプション												
	売建												
	コール	-			-	16,406				26,776			
	ブット	(-)	-	-	-	(80)	78	2	-	(52)	65	13	-
	買建	4,016		1	-	43,843	183	42	-	32,499	106	5	-
	コール	(3)	5		-	(140)			-	(112)			-
	ブット	44,478		22	-	43,843	71	50	-	32,499	78	21	-
		(132)	110		(121)			-	(99)			-	
		-			16,406	75	19	-	26,776	47	11	-	
		(-)	-		(95)			-	(58)			-	
	合計			865	-			434	-			259	-

(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、先物取引及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19年度第2四半期(上半期)末				平成20年度第2四半期(上半期)末				平成19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
店頭	クレジット・デフォルト・スワップ															
	オプション売建	10,000	10,000	8	8	-	2,000	2,000	29	29	-	4,000	4,000	51	51	-
	オプション買建	8,000	8,000	2	2	-	-	-	-	-	-	2,000	2,000	48	48	-
	合計				5	-			29	-				2	-	

(注) 差損益欄には、時価を記載しています。