

# デリバティブ取引情報(単体)

## 取引の時価等

### (1) 金利関連取引

(単位:百万円)

区分	種類	平成15年度末				平成16年度末				
		契約額等	うち1年超	時価	評価損益	契約額等	うち1年超	時価	評価損益	
取引所	金利先物	売 建	—	—	—	—	—	—	—	
		買 建	—	—	—	—	—	—	—	
	金利オプション	売 建	—	—	—	—	—	—	—	
		買 建	—	—	—	—	—	—	—	
店頭	金利先渡契約	売 建	—	—	—	—	—	—	—	
		買 建	—	—	—	—	—	—	—	
	金利スワップ	受取固定・支払変動	21,386	20,886	196	196	35,976	34,951	490	490
		受取変動・支払固定	41,386	40,886	△135	△135	55,976	44,951	△256	△256
		受取変動・支払変動	—	—	—	—	—	—	—	—
	金利オプション	売 建	—	—	—	—	18,170	—	△ 65	116
		買 建	—	—	—	—	18,170	—	65	△ 15
	その他	売 建	100	100	△ 0	0	8,487	8,487	△ 21	84
買 建		100	100	0	△ 0	8,487	8,487	21	△ 48	
合計				61	62			234	370	

- (注) 1. 上記取引については時価評価を行い、評価損益を損益計算書に計上しております。  
 なお、「銀行業における金融商品会計基準適用に関する会計上及び監査上の取扱い」(日本公認会計士協会業種別監査委員会報告第24号)等に基づき、ヘッジ会計を適用しているデリバティブ取引は、上記記載から除いております。
2. 時価の算定  
 取引所取引につきましては、東京金融先物取引所等における最終の価格によっております。店頭取引につきましては、割引現在価値やオプション価格計算モデル等により算定しております。

### (2) 通貨関連取引

(単位:百万円)

区分	種類	平成15年度末				平成16年度末				
		契約額等	うち1年超	時価	評価損益	契約額等	うち1年超	時価	評価損益	
店頭	通貨スワップ	3,408	1,275	6	6	2,310	1,820	32	32	
	為替予約	売 建	6,582	275	144	144	9,402	—	△ 199	△ 199
		買 建	1,806	273	△ 9	△ 9	4,342	—	61	61
	通貨オプション	売 建	18,153	7,282	△754	110	74,488	37,233	△2,500	1,288
		買 建	21,208	7,282	755	64	74,447	37,233	2,499	△ 556
	その他	売 建	—	—	—	—	—	—	—	—
買 建		—	—	—	—	—	—	—	—	
合計				140	315			△ 105	626	

- (注) 1. 上記取引については時価評価を行い、評価損益を損益計算書に計上しております。  
 なお、「銀行業における外貨建取引等の会計処理に関する会計上及び監査上の取扱い」(日本公認会計士協会業種別監査委員会報告第25号)等に基づきヘッジ会計を適用している通貨スワップ取引等および外貨建金銭債権債務等に付されたもので当該外貨建金銭債権債務等の貸借対照表表示に反映されているものについては、上記記載から除いております。
2. 時価の算定  
 割引現在価値等により算定しております。

(3) 株式関連取引 該当ありません。

(4) 債券関連取引 該当ありません。

(5) 商品関連取引 該当ありません。

(6) クレジットデリバティブ取引 該当ありません。