

デリバティブ取引情報(単体)

取引の時価等

(単位:百万円)

(1) 金利関連取引

区分	種類	平成16年度末				平成17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	121,834	118,659	2,479	2,855	277,396	272,671	△8,857	△8,857
		受取変動・支払固定	108,197	105,712	△ 287	△287	259,789	255,810	10,882	10,882
	金利オプション	売 建	—	—	—	—	161,185	127,752	△ 164	5,530
		買 建	—	—	—	—	161,173	127,740	164	164
	その他	売 建	94,030	73,591	△ 141	2,924	81,247	69,321	△ 429	2,555
		買 建	58,720	42,598	243	△521	47,277	39,527	586	△ 66
合計				2,294	4,970			2,182	10,209	

- (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

区分	種類	平成16年度末				平成17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	98,510	61,615	105	105	71,411	34,682	92	92	
	為替予約	売 建	15,757	1,529	△ 401	△ 401	27,805	—	△ 374	△ 374
		買 建	12,675	1,529	219	219	14,630	—	110	110
	通貨オプション	売 建	152,403	85,694	△6,118	1,871	243,666	166,951	△9,280	5,159
		買 建	152,403	85,694	6,117	75	243,666	166,951	9,280	△1,529
	その他	売 建	—	—	—	—	—	—	—	—
買 建		—	—	—	—	—	—	—	—	
合計				△ 76	1,870			△ 170	3,459	

- (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及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. 金融先物取引業者の業務の状況に関する事項(金融先物取引法第80条に基づく開示)
 ・直近3事業年度における、当行の金融先物取引業務に係る受入手数料はありません。
 ・直近3事業年度における、自己取引に係る損益はありません。
 ・直近3事業年度における使用人の総数は、平成15年度2,926人、平成16年度2,744人、平成17年度2,570人となっております。また、金融先物取引法第95条第1項に規定される外務員の総数は、平成15年度及び平成16年度は0人、平成17年度は1,863人となっております。

(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。