

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	35,976	34,951	490	490	111,274	109,902	△ 2,365	△ 2,365
		受取変動・支払固定	55,976	44,951	△ 256	△ 256	121,183	119,902	3,047	3,047
	金利オプション	売 建	18,170	—	△ 65	116	53,625	33,444	△ 154	939
		買 建	18,170	—	65	△ 15	53,625	33,444	154	138
	そ の 他	売 建	8,487	8,487	△ 21	84	7,766	7,666	△ 41	64
		買 建	8,487	8,487	21	△ 48	7,766	7,666	41	△ 28
合 計				234	370			682	1,796	

- (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	2,310	1,820	32	32	6,807	5,779	133	133	
	為 替 予 約	売 建	9,402	—	△ 199	△ 199	13,496	—	△ 204	△ 204
		買 建	4,342	—	61	61	10,301	—	△ 0	△ 0
	通貨オプション	売 建	74,488	37,233	△ 2,500	1,288	133,144	89,271	△ 6,100	2,689
		買 建	74,447	37,233	2,499	△ 556	133,074	89,271	6,100	△ 1,301
	そ の 他	売 建	—	—	—	—	—	—	—	—
買 建		—	—	—	—	—	—	—	—	
合 計				△ 105	626			△ 71	1,316	

- (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1,902人、平成16年度1,762人、平成17年度1,724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952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。