

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17年度中間期末				平成18年度中間期末				
		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	58,754	58,041	449	449	158,602	150,682	△776	△776
		受取変動・支払固定	78,754	68,041	△2	△2	204,612	191,692	1,144	1,144
		受取変動・支払変動	—	—	—	—	—	—	—	—
	金利オプション	売 建	24,701	—	△112	78	87,986	63,016	△290	1,598
		買 建	24,701	—	112	72	87,996	63,026	291	287
	その他	売 建	8,676	8,276	△27	85	7,711	2,537	△32	80
買 建		8,676	8,276	27	△46	7,711	2,537	32	△43	
合計				446	635			368	2,291	

- (注) 1. 上記取引については時価評価を行い、評価損益を中間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17年度中間期末				平成18年度中間期末				
		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	4,625	3,871	86	86	8,375	7,133	172	172	
	為替予約	売 建	10,822	—	△463	△463	3,660	—	△61	△61
		買 建	1,369	—	10	10	270	—	0	0
	通貨オプション	売 建	99,048	58,783	△3,711	1,923	144,569	117,572	△7,531	4,003
		買 建	98,996	58,783	3,710	△910	144,569	117,572	7,533	△2,214
	その他	売 建	—	—	—	—	—	—	—	—
買 建		—	—	—	—	—	—	—	—	
合計				△367	645			112	1,900	

- (注) 1. 上記取引については時価評価を行い、評価損益を中間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中間貸借対照表表示
 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。