

## (4) 金銭の信託の時価情報(会社計)

(単位:億円)

区分	平成20年度上半期末			
	貸借対照表 計上額	時価	差損益	うち差益
				うち差損
金銭の信託	1,529	1,529	—	—

区分	平成19年度末			
	貸借対照表 計上額	時価	差損益	うち差益
				うち差損
金銭の信託	1,705	1,705	—	—

(注) 1. 時価の算定は、金銭の信託の受託者が合理的に算出した価格によっています。

2. 貸借対照表計上額には、金銭の信託内で有しているデリバティブ取引に係る差損益を含んでいます。

## ・運用目的の金銭の信託

(単位:億円)

区分	平成20年度上半期末		平成19年度末	
	貸借対照表 計上額	当期の損益に 含まれた 評価損益	貸借対照表 計上額	当期の損益に 含まれた 評価損益
運用目的の金銭の信託	1,529	▲ 142	1,705	▲ 447

(注) 貸借対照表計上額及び当期の損益に含まれた評価損益には、デリバティブ取引に係る差損益を含んでいます。

## ・満期保有目的、責任準備金対応、その他の金銭の信託

平成20年度上半期末、平成19年度末に該当の残高はありません。

## (5) デリバティブ取引の状況(会社計)

## 1. 差損益の内訳(ヘッジ会計適用分・非適用分の内訳)(平成20年度上半期末)

(単位:億円)

	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	—	882	—	—	—	882
ヘッジ会計非適用分	—	81	▲ 32	—	▲ 151	▲ 102
合計	—	963	▲ 32	—	▲ 151	779

(注) ヘッジ会計適用分のうち時価ヘッジ適用分の差損益は損益計算書に計上しています。

## 2. 金利関連

(単位:億円)

区分	種類	平成20年度上半期末			平成19年度末				
		契約額等		時価	差損益	契約額等		時価	差損益
		うち1年超				うち1年超			
店頭	金利スワップ								
	固定金利受取/変動金利支払	—	—	—	—	—	—	—	
	固定金利支払/変動金利受取	—	—	—	—	—	—	—	
合計									

(注) 「差損益」欄には、スワップ取引については、時価(現在価値)を記載しています。

3. 通貨関連

(単位:億円)

区分	種類	平成20年度上半期末				平成19年度末			
		契約額等		時価	差損益	契約額等		時価	差損益
		うち1年超				うち1年超			
店頭	為替予約								
	売建	37,325	2,488	36,321	1,003	26,986	2,773	26,851	135
	米ドル	34,509	2,488	33,625	884	26,157	2,773	26,027	129
	ユーロ	1,513	—	1,480	33	558	—	554	4
	買建	3,876	—	3,778	▲ 97	2,431	—	2,445	14
	米ドル	2,328	—	2,271	▲ 56	2,149	—	2,160	11
	ユーロ	1,094	—	1,073	▲ 20	267	—	270	2
	通貨オプション								
	売建								
	コール	—	—	—	—	1,102	—	1	▲ 0
	米ドル	(—)	(—)	—	—	(1)	(—)	1	▲ 0
	ユーロ	—	—	—	—	—	—	—	—
	プット	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—
	米ドル	521	—	7	▲ 0	—	—	—	—
	ユーロ	(7)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—
	買建	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—
	コール	—	—	—	—	—	—	—	—
	米ドル	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—
	ユーロ	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—
	プット	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—
	米ドル	7,940	3,910	341	59	8,241	1,550	380	212
	ユーロ	(282)	(185)	—	—	(167)	(53)	—	—
	米ドル	6,524	3,314	292	46	5,510	601	335	222
ユーロ	(246)	(165)	—	—	(112)	(24)	—	—	
通貨スワップ	1,415	596	49	13	2,531	949	38	▲ 13	
米ドル	(35)	(20)	—	—	(52)	(28)	—	—	
ユーロ	78	78	▲ 0	▲ 0	5	5	▲ 0	▲ 0	
米ドル	78	78	▲ 0	▲ 0	5	5	▲ 0	▲ 0	
ユーロ	—	—	—	—	—	—	—	—	
合計				963				362	

(注) 1. ( )内にはオプション料を記載しています。

2. ヘッジ会計を適用したものを含まず。

3. 「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、スワップ取引については、時価(現在価値)を記載しています。

4. 株式関連

(単位:億円)

区分	種類	平成20年度上半期末				平成19年度末			
		契約額等		時価	差損益	契約額等		時価	差損益
		うち1年超				うち1年超			
取引所	株価指数先物								
	売建	—	—	—	—	—	—	—	—
	買建	437	—	404	▲ 32	247	—	246	▲ 1
合計					▲ 32				▲ 1

(注) 「差損益」欄には、契約額と時価との差額を記載しています。

5. 債券関連

平成20年度上半期末、平成19年度末に該当の残高はありません。

6. その他

(単位:億円)

区分	種類	平成20年度上半期末				平成19年度末			
		契約額等		時価	差損益	契約額等		時価	差損益
		うち1年超				うち1年超			
店頭	クレジット・デフォルト・スワップ								
	プロテクション売建	240	240	▲ 151	▲ 151	—	—	—	—
合計					▲ 151				—

(注) 1. 上表は、複合金融商品に組み込まれたデリバティブについて、従来現物の金融資産と一体処理していたものうち区分処理に移行したものを記載しています。

2. 「契約額等」欄には、当該デリバティブが組み込まれている複合金融商品の額面金額を記載しています。