

(4) 金銭の信託の時価情報 (会社計)

(単位：億円)

区分	平成22年度末					平成23年度上半期末				
	貸借対照表 計上額	時価	差損益			貸借対照表 計上額	時価	差損益		
			差益	差損				差益	差損	
金銭の信託	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—

(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22年度末		平成23年度上半期末	
	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	—	24	—	—

(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22年度末、平成23年度上半期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23年度上半期末)

(単位：億円)

区分	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	—	1,352	—	—	—	1,352
ヘッジ会計非適用分	—	122	0	—	—	122
合計	—	1,474	0	—	—	1,474

(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. ヘッジ会計が適用されていないもの

(a) 金利関連

平成22年度末、平成23年度上半期末に該当の残高はありません。

## (b) 通貨関連

(単位：億円)

区分	種類	平成22年度末				平成23年度上半期末					
		契約額等	うち1年超		時価	差損益	契約額等	うち1年超		時価	差損益
店頭	為替予約										
	売建	8,304	—	8,478	▲ 174	7,390	—	7,275	114		
	米ドル	5,162	—	5,218	▲ 56	4,312	—	4,259	53		
	ユーロ	2,296	—	2,389	▲ 92	1,724	—	1,685	39		
	買建	8,804	—	8,988	184	2,289	—	2,284	▲ 4		
	米ドル	5,443	—	5,530	86	955	—	958	2		
	ユーロ	2,186	—	2,244	57	417	—	417	0		
	通貨オプション										
	売建										
	コール	1,247	—	1	0	—	—	—	—		
	(1)	(1)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—		
	米ドル	1,247	—	1	0	—	—	—	—		
	(1)	(1)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—		
	ユーロ	—	—	—	—	—	—	—	—		
	(—)	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—		
	プット	—	—	—	—	618	—	34	▲ 9		
	(—)	(—)	(—)	—	—	(25)	(—)	—	—		
	米ドル	—	—	—	—	306	—	10	▲ 0		
	(—)	(—)	(—)	—	—	(9)	(—)	—	—		
	ユーロ	—	—	—	—	312	—	24	▲ 9		
	(—)	(—)	(—)	—	—	(15)	(—)	—	—		
	買建	—	—	—	—	—	—	—	—		
	コール	—	—	—	—	—	—	—	—		
	(—)	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—		
	米ドル	—	—	—	—	—	—	—	—		
	(—)	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—		
ユーロ	—	—	—	—	—	—	—	—			
(—)	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—			
プット	1,247	—	0	▲ 1	1,440	—	64	22			
(1)	(1)	(—)	—	—	(42)	(—)	—	—			
米ドル	1,247	—	0	▲ 1	919	—	24	2			
(1)	(1)	(—)	—	—	(21)	(—)	—	—			
ユーロ	—	—	—	—	520	—	40	19			
(—)	(—)	(—)	—	—	(20)	(—)	—	—			
通貨スワップ	—	—	—	—	—	—	—	—			
米ドル	—	—	—	—	—	—	—	—			
ユーロ	—	—	—	—	—	—	—	—			
合計				9				122			

(注) 1. ( ) 内にはオプション料を記載しています。

2. 「差損益」欄には、先渡取引については、契約額等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。

## (c) 株式関連

(単位：億円)

区分	種類	平成22年度末				平成23年度上半期末					
		契約額等	うち1年超		時価	差損益	契約額等	うち1年超		時価	差損益
取引所	株価指数先物										
	売建	—	—	—	—	—	—	—	—		
	買建	153	—	144	▲ 8	115	—	115	0		
店頭	株式オプション										
	売建										
	コール	—	—	—	—	—	—	—	—		
	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—			
	プット	—	—	—	—	—	—	—	—		
	(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—			
買建	—	—	—	—	—	—	—	—			
コール	1	1	0	▲ 0	1	1	0	▲ 0			
(0)	(0)	—	—	(0)	(0)	—	—	—			
プット	—	—	—	—	—	—	—	—			
(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—	—			
合計				▲ 8				0			

(注) 1. ( ) 内にはオプション料を記載しています。

2. 「差損益」欄には、先物取引については、契約額等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ています。

## (d) 債券関連

平成22年度末、平成23年度上半期末に該当の残高はありません。

## (e) その他

平成22年度末、平成23年度上半期末に該当の残高はありません。

3. ヘッジ会計が適用されているもの

(a) 金利関連

平成22年度末、平成23年度上半期末に該当の残高はありません。

(b) 通貨関連

(単位：億円)

区分	ヘッジ会計の方法	種類	主なヘッジ対象	平成22年度末				平成23年度上半期末				
				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	時価ヘッジ	為替予約	外貨建債券									
		売建		48,175	—	49,094	▲ 918	44,176	—	42,988	1,188	
		米ドル		29,592	—	29,837	▲ 244	28,813	—	28,682	130	
		ユーロ		4,818	—	5,079	▲ 260	4,078	—	3,812	265	
		買建		—	—	—	—	—	—	—	—	
		米ドル		—	—	—	—	—	—	—	—	
		ユーロ		—	—	—	—	—	—	—	—	
		通貨オプション										
		売建										
		コール		—	—	—	—	—	—	—	—	—
		米ドル		(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—	—
		ユーロ		(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—	—
		プット		—	—	—	—	—	—	—	—	—
		米ドル		(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—	—
		ユーロ		(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—	—
		買建		—	—	—	—	—	—	—	—	—
		コール		(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—	—
		米ドル		(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—	—
		ユーロ		(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—	—
		プット		—	—	—	—	—	—	—	—	—
		米ドル		(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—	—
		ユーロ		(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—	—	—
				(—)	(—)	—	—	(—)	(—)	—		
	繰延ヘッジ	通貨スワップ	外貨建債券	1,559	1,559	106	106	2,430	2,430	163	163	
		米ドル		644	644	34	34	1,318	1,318	46	46	
		ユーロ		888	888	72	72	1,085	1,085	115	115	
合	計						▲ 812				1,352	

(注) 1. ( ) 内にはオプション料を記載しています。

2. 「差損益」欄には、先渡取引については、契約額等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。

(c) 株式関連

平成22年度末、平成23年度上半期末に該当の残高はありません。

(d) 債券関連

平成22年度末、平成23年度上半期末に該当の残高はありません。

(e) その他

平成22年度末、平成23年度上半期末に該当の残高はありません。