

(4) 金銭の信託の時価情報 (会社計)

- ・運用目的の金銭の信託

平成24年度末、平成25年度上半期末に該当の残高はありません。

- ・満期保有目的、責任準備金対応、その他の金銭の信託

平成24年度末、平成25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25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	—	△1,493	△4	—	—	△1,498
ヘッジ会計非適用分	—	△4	△16	—	—	△20
合計	—	△1,498	△21	—	—	△1,519

(注) ヘッジ会計適用分のうち時価ヘッジ適用分の差損益、及びヘッジ会計非適用分のうちヘッジ会計の中止に伴う繰延ヘッジ損益の未償却額を除いた差損益は、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24年度末、平成25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24年度末				平成25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	1,518	—	1,517	1	2,175	—	2,180	△5		
	米ドル	665	—	666	△0	954	—	952	1		
	ユーロ	570	—	567	3	538	—	544	△6		
	買建	905	—	902	△3	1,178	—	1,180	1		
	米ドル	403	—	399	△3	624	—	623	△0		
	ユーロ	361	—	361	0	307	—	308	0		
	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	—	—	—	—	—	—	—	—	—		
(—)	(—)	(—)	(—)	(—)	(—)	(—)	(—)	(—)	(—)		
通貨スワップ	—	—	—	—	—	—	—	—	—		
米ドル	—	—	—	—	—	—	—	—	—		
ユーロ	—	—	—	—	—	—	—	—	—		
合計					△1				△4		

(注) 1. ()内には、貸借対照表に計上した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24年度末				平成25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	—	—	—	—	1,453	—	1,469	△15		
	買建	112	—	113	1	279	—	278	△1		
店頭	株式先渡契約										
	売建	—	—	0	△0	—	—	—	—	—	
	買建	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
	株式オプション										
	売建										
	コール	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
	(—)	(—)	(—)	(—)	(—)	(—)	(—)	(—)	(—)	(—)	
プット	—	—	—	—	—	—	—	—	—		
(—)	(—)	(—)	(—)	(—)	(—)	(—)	(—)	(—)	(—)		
買建											
コール	2	1	0	0	2	2	1	0			
(0)	(0)	(0)	(0)	(0)	(0)	(0)	(0)	(0)			
プット	—	—	—	—	—	—	—	—	—		
(—)	(—)	(—)	(—)	(—)	(—)	(—)	(—)	(—)	(—)		
合計					1				△16		

(注) 1. ()内には、貸借対照表に計上したオプション料を記載しています。

2. 「差損益」欄には、先物取引及び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ています。

(d) 債券関連

平成24年度末、平成25年度上半期末に該当の残高はありません。

(e) その他

平成24年度末、平成25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24年度末、平成25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24年度末				平成25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		60,616	-	62,139	△1,523	60,227	-	60,508	△281
		米ドル		37,262	-	38,126	△863	35,676	-	35,294	381
		ユーロ		9,468	-	9,454	14	10,638	-	10,975	△337
		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	5,321	5,308	△1,069	△1,069	6,729	6,717	△1,212	△1,212
		米ドル	2,439	2,427	△482	△482	3,149	3,136	△468	△468	
		ユーロ	2,790	2,790	△563	△563	3,229	3,229	△717	△717	
合 計							△2,592				△1,493

(注) 1. ()内には、貸借対照表に計上した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	ヘッジ会計の方法	種類	主なヘッジ対象	平成24年度末			平成25年度上半期末		
				契約額等	時価	差損益	契約額等	時価	差損益
取引所	時価ヘッジ	株価指数先物							
		売建	—	—	—	361	—	366	△4
		買建	—	—	—	—	—	—	—
合計									△4

(注) 「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ています。

(d) 債券関連

平成24年度末、平成25年度上半期末に該当の残高はありません。

(e) その他

平成24年度末、平成25年度上半期末に該当の残高はありません。