

## 1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引について、取引の対象物の種類ごとの決算日における契約額又は契約において定められた元本相対額、時価及び評価損益並びに当該時価の算定方法は、次のとおりであります。なお、契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

## (1) 金利関連取引

(単位：百万円)

区分	種類	平成22年3月31日				平成23年3月31日			
		契約額等	契約額等のうち 1年超のもの	時価	評価損益	契約額等	契約額等のうち 1年超のもの	時価	評価損益
金融商品取引所	金利先物	売建	—	—	—	—	—	—	—
		買建	—	—	—	—	—	—	—
	金利オプション	売建	—	—	—	—	—	—	—
		買建	—	—	—	—	—	—	—
	先渡契約	売建	—	—	—	—	—	—	—
		買建	—	—	—	—	—	—	—
店頭	金利スワップ	受取固定・支払変動	—	—	—	—	—	—	—
		受取変動・支払固定	100	100	△ 4	△ 4	100	—	△ 1
		受取変動・支払変動	—	—	—	—	—	—	—
店頭	金利オプション	売建	—	—	—	—	—	—	—
		買建	—	—	—	—	—	—	—
	その他	売建	—	—	—	—	—	—	—
		買建	—	—	—	—	—	—	—
合計		—	—	△ 4	△ 4	—	—	△ 1	△ 1

(注) 1. 上記取引については時価評価を行ない、評価損益を損益計算書に計上しております。  
2. 時価の算定  
店頭取引につきましては、割引現在価値等により算定しております。

## (2) 通貨関連取引

(単位：百万円)

区分	種類	平成22年3月31日				平成23年3月31日				
		契約額等	契約額等のうち 1年超のもの	時価	評価損益	契約額等	契約額等のうち 1年超のもの	時価	評価損益	
金融商品取引所	通貨先物	売建	—	—	—	—	—	—	—	
		買建	—	—	—	—	—	—	—	
	通貨オプション	売建	—	—	—	—	—	—	—	
		買建	—	—	—	—	—	—	—	
通貨スワップ		22,233	20,879	158	158	16,769	16,425	124	124	
店頭	為替予約	売建	439	—	△ 7	△ 7	384	—	2	2
		買建	200	—	0	0	116	—	△ 1	△ 1
	通貨オプション	売建	9,473	9,473	△ 752	△ 44	6,237	6,237	△ 726	△ 181
		買建	9,473	9,473	752	196	6,237	6,237	726	292
その他	売建	—	—	—	—	—	—	—	—	
	買建	—	—	—	—	—	—	—	—	
合計		—	—	152	303	—	—	126	237	

(注) 1. 上記取引については時価評価を行ない、評価損益を損益計算書に計上しております。  
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

該当する取引はありません。

## (4) 債券関連取引

該当する取引はありません。

## (5) 商品関連取引

該当する取引はありません。

## (6) クレジットデリバティブ取引

該当する取引はありません。

## 2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引について、取引の対象物の種類ごと、ヘッジ会計の方法別の決算日における契約額又は契約において定められた元本相当額及び時価並びに当該時価の算定方法は、次のとおりであります。なお、契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

### (1) 金利関連取引

(単位：百万円)

ヘッジ会計の方法	種類		平成22年3月31日			平成23年3月31日			
			主なヘッジ対象	契約額等	契約額等のうち1年超のもの	時価	主なヘッジ対象	契約額等	契約額等のうち1年超のもの
原則的 処理方法	金利 スワップ	受取固定・支払変動	—	—	—	—	—	—	—
		受取変動・支払固定	—	—	—	—	—	—	—
	金利 オプション	売 建	—	—	—	—	—	—	—
		買 建	—	—	—	—	—	—	—
	その他	売 建	—	—	—	—	—	—	—
		買 建	—	—	—	—	—	—	—
金利スワップの 特例処理 合計	金利 スワップ	受取固定・支払変動	貸出金	—	—	—	貸出金	—	—
		受取変動・支払固定		14,000	14,000	309		14,000	14,000
			—	—	—	309	—	—	38

(注) 時価の算定  
店頭取引につきましては、割引現在価値等により算定しております。

### (2) 通貨関連取引

該当する取引はありません。

### (3) 株式関連取引

該当する取引はありません。

### (4) 債券関連取引

該当する取引はありません。