

# 金銭の信託関係／その他有価証券評価差額金／デリバティブ情報

## 金銭の信託関係

### 1.満期保有目的の金銭の信託

該当事項はありません。

### 2.その他の金銭の信託（運用目的及び満期保有目的以外）

該当事項はありません。

## その他有価証券評価差額金

中間貸借対照表に計上されているその他有価証券評価差額金の内訳は、次のとおりであります。

(単位：百万円)

|                         | 平成22年9月30日 | 平成23年9月30日 |
|-------------------------|------------|------------|
| 評 価 差 額                 | 10,140     | 10,139     |
| そ の 他 有 価 証 券           | 10,140     | 10,139     |
| そ の 他 の 金 銭 の 信 託       | —          | —          |
| 繰延税金資産(又は(△)繰延税金負債)     | △4,059     | △4,054     |
| そ の 他 有 価 証 券 評 価 差 額 金 | 6,080      | 6,085      |

## デリバティブ情報

〈平成22年度中間〉

### 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中間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、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9月30日 |        |      |      |
|---------|---------------|------------|--------|------|------|
|         |               | 契約額等       | うち1年超  | 時 価  | 評価損益 |
| 金融商品取引所 | 金 利 先 物       | —          | —      | —    | —    |
|         | 金 利 オ プ シ ョ ン | —          | —      | —    | —    |
| 店 頭     | 金 利 先 渡 契 約   | —          | —      | —    | —    |
|         | 金 利 ス ワ ッ プ   | —          | —      | —    | —    |
|         | 受取固定・支払変動     | —          | —      | —    | —    |
|         | 受取変動・支払固定     | 15,244     | 13,477 | △297 | △297 |
|         | 受取変動・支払変動     | —          | —      | —    | —    |
|         | 金 利 オ プ シ ョ ン | —          | —      | —    | —    |
| 合 計     | そ の 他         | —          | —      | —    | —    |
|         |               |            |        | △297 | △297 |

(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。

2. 時価の算定

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

(単位：百万円)

| 区 分     | 種 類           | 平成22年9月30日 |       |     |      |
|---------|---------------|------------|-------|-----|------|
|         |               | 契約額等       | うち1年超 | 時 価 | 評価損益 |
| 金融商品取引所 | 通 貨 先 物       | —          | —     | —   | —    |
|         | 通 貨 オ プ シ ョ ン | —          | —     | —   | —    |
| 店 頭     | 通 貨 ス ワ ッ プ   | 6,493      | —     | 14  | 14   |
|         | 為 替 予 約       | —          | —     | —   | —    |
|         | 売 建           | 1,184      | 48    | 48  | 48   |
|         | 買 建           | 3,797      | 47    | △24 | △24  |
|         | 通 貨 オ プ シ ョ ン | —          | —     | —   | —    |
|         | そ の 他         | —          | —     | —   | —    |
| 合 計     |               |            |       | 38  | 38   |

(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。

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、(4) 債券関連取引、(5) 商品関連取引、(6) クレジットデリバティブ取引

該当事項はありません。

# デリバティブ情報

## 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中間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9月30日 |         |         |        |
|-------------|-------------|------------|---------|---------|--------|
|             |             | 主なヘッジ対象    | 契約額等    | うち1年超   | 時 価    |
| 原則的処理方法     | 金 利 ス ワ ッ プ |            |         |         |        |
|             | 受取固定・支払変動   | 貸出金        | —       | —       | —      |
|             | 受取変動・支払固定   |            | 162,290 | 154,359 | △3,554 |
| 金利スワップの特例処理 | 金 利 ス ワ ッ プ |            |         |         |        |
|             | 受取固定・支払変動   | 貸出金        | —       | —       | —      |
|             | 受取変動・支払固定   |            | 19,075  | 16,378  | △710   |
| 合           | 計           |            |         |         | △4,265 |

(注) 1. 主として「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）に基づき、繰延ヘッジによっております。

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、(3) 株式関連取引、(4) 債券関連取引

該当事項はありません。

## 〈平成23年度中間〉

### 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中間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、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23年9月30日 |        |      |      |
|---------|---------------|------------|--------|------|------|
|         |               | 契約額等       | うち1年超  | 時 価  | 評価損益 |
| 金融商品取引所 | 金 利 先 物       | —          | —      | —    | —    |
|         | 金 利 オ プ シ ョ ン | —          | —      | —    | —    |
| 店 頭     | 金 利 先 渡 契 約   | —          | —      | —    | —    |
|         | 金 利 ス ワ ッ プ   |            |        |      |      |
|         | 受取固定・支払変動     | —          | —      | —    | —    |
|         | 受取変動・支払固定     | 15,175     | 13,083 | △319 | △319 |
|         | 受取変動・支払変動     | —          | —      | —    | —    |
|         | 金 利 オ プ シ ョ ン | —          | —      | —    | —    |
|         | そ の 他         | —          | —      | —    | —    |
| 合       | 計             |            |        | △319 | △319 |

(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。

2. 時価の算定

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

(単位：百万円)

| 区 分     | 種 類           | 平成23年9月30日 |       |     |      |
|---------|---------------|------------|-------|-----|------|
|         |               | 契約額等       | うち1年超 | 時 価 | 評価損益 |
| 金融商品取引所 | 通 貨 先 物       | —          | —     | —   | —    |
|         | 通 貨 オ プ シ ョ ン | —          | —     | —   | —    |
| 店 頭     | 通 貨 ス ワ ッ プ   | 4,229      | —     | 14  | 14   |
|         | 為 替 予 約       | —          | —     | —   | —    |
|         | 売 建           | 820        | 5     | 71  | 71   |
|         | 買 建           | 810        | 4     | △48 | △48  |
|         | 通 貨 オ プ シ ョ ン | —          | —     | —   | —    |
| そ の 他   |               | —          | —     | —   | —    |
| 合 計     |               |            |       | 38  | 38   |

(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。

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、(4) 債券関連取引、(5) 商品関連取引、(6) クレジットデリバティブ取引

該当事項はありません。

## 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中間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23年9月30日 |         |        |        |
|-------------|-------------|------------|---------|--------|--------|
|             |             | 主なヘッジ対象    | 契約額等    | うち1年超  | 時 価    |
| 原則的処理方法     | 金 利 ス ワ ッ プ |            |         |        |        |
|             | 受取固定・支払変動   | 貸出金        | —       | —      | —      |
|             | 受取変動・支払固定   |            | 115,864 | 96,471 | △2,568 |
| 金利スワップの特例処理 | 金 利 ス ワ ッ プ |            |         |        |        |
|             | 受取固定・支払変動   | 貸出金        | —       | —      | —      |
|             | 受取変動・支払固定   |            | 14,963  | 12,963 | △578   |
| 合 計         |             |            |         |        | △3,147 |

(注) 1. 主として「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）に基づき、繰延ヘッジによっております。

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、(3) 株式関連取引、(4) 債券関連取引

該当事項はありません。