

4.デリバティブ取引の定量的情報

ア.差損益の内訳(ヘッジ会計適用分・非適用分の内訳)

(単位:百万円)

区 分	平成14年度末					合計
	金利関連	通貨関連	株式関連	債券関連	その他	
ヘッジ会計適用分	10,136	1,540	—	—	—	11,677
ヘッジ会計非適用分	542	△106	—	—	—	436
合 計	10,679	1,434	—	—	—	12,113

(単位:百万円)

区 分	平成13年度末					合計
	金利関連	通貨関連	株式関連	債券関連	その他	
ヘッジ会計適用分	11,095	△36,242	—	—	—	△25,147
ヘッジ会計非適用分	900	△107	△4	—	—	788
合 計	11,995	△36,350	△4	—	—	△24,358

(注) ヘッジ会計適用分のうち時価ヘッジ適用分の差損益(平成14年度末:通貨関連1,540万円、平成13年度末:通貨関連△36,242百万円)、およびヘッジ会計非適用分の差損益は、損益計算書に計上しています。

イ.金利関連(ヘッジ会計適用分・非適用分の合算値)

(単位:百万円)

区 分	平成14年度末				平成13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 金利スワップ								
固定金利受取/変動金利支払	368,978	318,295	10,984	10,984	403,757	367,932	12,358	12,358
頭 固定金利支払/変動金利受取	3,000	3,000	△305	△305	3,000	3,000	△362	△362
合 計				10,679				11,995

【参考】金利スワップ契約の残存期間別構成

(単位:百万円、%)

区 分	平成14年度末							合 計
	1年以下	1年超 3年以下	3年超 5年以下	5年超 7年以下	7年超 10年以下	10年超		
固定金利受取	50,683	209,918	93,750	4,000	10,627	—	368,978	
想定元本								
変動金利支払	2.06	1.56	1.29	2.13	1.02	—	1.55	
平均受取金利								
スワップ	0.34	0.30	0.23	0.79	0.16	—	0.29	
平均支払金利								
固定金利支払	—	—	3,000	—	—	—	3,000	
想定元本								
変動金利受取	—	—	0.13	—	—	—	0.13	
平均受取金利								
スワップ	—	—	3.13	—	—	—	3.13	
平均支払金利								

(単位:百万円、%)

区 分	平成13年度末							合 計
	1年以下	1年超 3年以下	3年超 5年以下	5年超 7年以下	7年超 10年以下	10年超		
固定金利受取	35,825	104,676	232,175	19,500	11,581	—	403,757	
想定元本								
変動金利支払	0.98	1.99	1.35	1.73	1.01	—	1.49	
平均受取金利								
スワップ	0.31	0.62	0.17	0.28	0.19	—	0.31	
平均支払金利								
固定金利支払	—	—	3,000	—	—	—	3,000	
想定元本								
変動金利受取	—	—	0.15	—	—	—	0.15	
平均受取金利								
スワップ	—	—	3.13	—	—	—	3.13	
平均支払金利								

ウ.通貨関連(ヘッジ会計適用分・非適用分の合算値)

(単位:百万円)

区 分	平成14年度末				平成13年度末			
	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
為替予約								
店 売建	181,049	—	179,718	1,331	584,060	—	620,416	△36,356
米ドル	157,287	—	155,808	1,479	545,119	—	581,441	△36,322
ユーロ	23,710	—	23,858	△148	30,064	—	30,066	△1
デンマーククローネ	51	—	52	△0	—	—	—	—
英ポンド	—	—	—	—	8,876	—	8,909	△32
買建	47,319	—	47,422	103	713	—	719	6
頭 米ドル	37,520	—	37,501	△18	567	—	573	6
ユーロ	9,747	—	9,868	121	13	—	13	0
デンマーククローネ	51	—	52	0	—	—	—	—
英ポンド	—	—	—	—	132	—	132	△0
合 計				1,434				△36,350

(注) 外貨建金銭債権債務等が為替予約等が付されていることにより、決済時における円貨額が確定している外貨建金銭債権債務等で、貸借対照表において当該円貨額で表示されているものについては、開示の対象より除いています。

エ.株式関連(ヘッジ会計適用分・非適用分の合算値)

(単位:百万円)

区 分	平成14年度末				平成13年度末			
	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
株価指数先物								
取 売建	—	—	—	—	—	—	—	—
引 買建	—	—	—	—	10	—	10	0
所 外国株価指数先物								
売建	—	—	—	—	—	—	—	—
買建	—	—	—	—	2,712	—	2,708	△4
合 計				—				△4

オ.債券関連(ヘッジ会計適用分・非適用分の合算値)

平成14年度末、平成13年度末とも保有していません。