

(2) 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16年度上半期末					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	△2,910	△6,663	—	—	—	△9,573
ヘッジ会計非適用分	—	△0	—	—	—	△0
合 計	△2,910	△6,663	—	—	—	△9,573

(単位:百万円)

区 分	平成17年度上半期末					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	△6,140	—	—	—	—	△6,140
ヘッジ会計非適用分	—	△76	—	—	—	△76
合 計	△6,140	△76	—	—	—	△6,216

(単位:百万円)

区 分	平成16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	△5,563	△4,788	—	—	—	△10,351
ヘッジ会計非適用分	—	△21	—	—	—	△21
合 計	△5,563	△4,810	—	—	—	△10,373

(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16年度上半期末:通貨関連△6,663百万円、平成16年度末:通貨関連△4,788百万円)、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)

店 頭	区 分	平成16年度上半期末				平成17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		
	金利スワップ								
	固定金利受取/変動金利支払	307,011	237,211	4,536	4,536	260,610	127,985	1,641	1,641
	固定金利支払/変動金利受取	103,000	103,000	△7,446	△7,446	103,000	100,000	△7,781	△7,781
	合 計			△2,910	△2,910			△6,140	△6,140

(単位:百万円)

店 頭	区 分	平成16年度末			
		契約額等	時 価		差損益
			うち1年超		
	金利スワップ				
	固定金利受取/変動金利支払	307,357	152,932	3,590	3,590
	固定金利支払/変動金利受取	103,000	103,000	△9,153	△9,153
	合 計			△5,563	△5,563

【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16年度上半期末						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 変動金利支払 スワップ	想定元本	69,800	190,266	26,280	19,665	1,000	—	307,011
	平均受取金利	1.29	1.37	1.23	0.99	1.18	—	1.32
	平均支払金利	0.15	0.14	0.39	0.14	0.22	—	0.17
固定金利支払 変動金利受取 スワップ	想定元本	—	3,000	—	—	—	100,000	103,000
	平均受取金利	—	0.11	—	—	—	1.25	1.21
	平均支払金利	—	3.13	—	—	—	3.57	3.56

(単位:百万円、%)

区 分		平成17年度上半期末						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 変動金利支払 スワップ	想定元本	132,625	74,425	15,080	19,167	19,312	—	260,610
	平均受取金利	1.36	1.37	1.13	1.00	1.31	—	1.32
	平均支払金利	0.12	0.26	0.35	0.08	0.20	—	0.18
固定金利支払 変動金利受取 スワップ	想定元本	3,000	—	—	—	—	100,000	103,000
	平均受取金利	0.12	—	—	—	—	1.25	1.22
	平均支払金利	3.13	—	—	—	—	3.57	3.56

(単位:百万円、%)

区 分		平成16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 変動金利支払 スワップ	想定元本	154,425	97,033	22,630	19,668	13,600	—	307,357
	平均受取金利	1.44	1.26	1.03	1.00	1.25	—	1.32
	平均支払金利	0.11	0.26	0.36	0.08	0.17	—	0.18
固定金利支払 変動金利受取 スワップ	想定元本	—	3,000	—	—	—	100,000	103,000
	平均受取金利	—	0.07	—	—	—	1.25	1.22
	平均支払金利	—	3.13	—	—	—	3.57	3.56

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16年度上半期末				平成17年度上半期末				平成16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	契約額等	うち 1年超	時価	差損益	
店	為替予約 売建	429,036	-	435,699	△6,663	30,781	-	30,860	△79	208,808	-	213,631	△4,822
	米ドル	429,036	-	435,699	△6,663	2,964	-	3,040	△75	198,728	-	203,516	△4,788
	ユーロ	-	-	-	-	27,816	-	27,820	△3	10,080	-	10,114	△34
頭	買建	11,346	-	11,345	△0	494	-	497	3	2,486	-	2,499	12
	米ドル	8,171	-	8,154	△16	-	-	-	-	-	-	-	-
	ユーロ	-	-	-	-	494	-	497	3	943	-	947	3
	英ポンド	3,174	-	3,190	15	-	-	-	-	1,543	-	1,552	9
	合 計				△6,663				△76				△4,810

(注) 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、貸借対照表において当該円貨額で表示されている外貨建金銭債権債務等にかかる取引を除いています。

エ. 株式関連 (ヘッジ会計適用分・非適用分の合算値)

平成16年度上半期末、平成17年度上半期末および平成16年度末とも保有していません。

オ. 債券関連 (ヘッジ会計適用分・非適用分の合算値)

平成16年度上半期末、平成17年度上半期末および平成16年度末とも保有していません。