

イ.定量的情報

a.差損益の内訳（ヘッジ会計適用分・非適用分の内訳）（平成12年度末）

(単位:百万円)

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	11,584	—	—	—	—	11,584
	ヘッジ会計非適用分	1,094	8,495	—	—	—	7,400
	合 計	12,679	8,495	—	—	—	4,183

（注）ヘッジ会計非適用分の差損益については、損益計算書に計上しております。

b.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)

種 類		平成12年度末				平成11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								
頭	固定金利受取 / 変動金利支払	356,363	332,801	13,083	13,083	534,413	480,964	3,124	3,124
	固定金利支払 / 変動金利受取	3,000	3,000	404	404	45,500	44,500	512	512
合 計					12,679				2,612

(ご参考)金利スワップ契約の残存期間別構成（平成12年度末）

(単位:百万円、%)

区 分		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	合 計
固定金利受取 変動金利支払 スワップ	想定元本	23,562	93,508	187,793	48,500	3,000	—	356,363
	平均受取金利	1.72	1.57	1.83	1.73	2.40	—	1.75
	平均支払金利	0.71	0.54	0.57	0.37	1.34	—	0.55
固定金利支払 変動金利受取 スワップ	想定元本	—	—	—	3,000	—	—	3,000
	平均受取金利	—	—	—	0.56	—	—	0.56
	平均支払金利	—	—	—	3.13	—	—	3.13

c.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)

種 類		平成12年度末				平成11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 頭	為替予約								
	売建	56,160	—	64,656	8,495	80,911	—	79,704	1,207
	米ドル	28,595	—	33,413	4,818	80,911	—	79,704	1,207
	ユーロ	19,857	—	22,393	2,535	—	—	—	—
	ボンド	7,707	—	8,849	1,141	—	—	—	—
合 計					8,495				1,207

（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おります。

d.株式関連（ヘッジ会計適用分・非適用分の合算値）

平成12年度末、平成11年度末とも保有しておりません。

e.債券関連（ヘッジ会計適用分・非適用分の合算値）

平成12年度末、平成11年度末とも保有しておりません。