

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）（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	8,488	25	11	—	7,379
合 計	12,679	8,488	25	11	—	4,204

（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。

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）

種 類	平成12年度末				平成11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
店 金利スワップ								
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
頭 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

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

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）

種 類	平成12年度末				平成11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	56,258	—	64,755	8,497	80,911	—	79,704	1,207
米ドル	28,692	—	33,512	4,819	80,911	—	79,704	1,207
ユーロ	19,857	—	22,393	2,535	—	—	—	—
頭 ボンド	7,707	—	8,849	1,141	—	—	—	—
買建	140	—	148	8	258	—	258	0
米ドル	140	—	148	8	258	—	258	0
合 計				8,488				1,206

（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。

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）

種 類	平成12年度末				平成11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	254	—	280	25	81,713	—	84,363	2,650
所 外国株価指数先物								
売建	—	—	—	—	—	—	—	—
買建	—	—	—	—	146	—	160	13
合 計				25				2,663

オ.債券関連（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	うち1年超	時価	差損益	契約額等	うち1年超	時価	差損益
債券先物								
取 売建	—	—	—	—	—	—	—	—
引 買建	3,069	—	3,058	11	—	—	—	—
所 合 計				11				—