

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

(単位:百万円)

区 分	平成12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	11,584					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います。また、通貨関連のヘッジ会計適用分については、時価ヘッジを適用しており、当該差損益を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)

種 類	平成13年度末				平成12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										
頭 固定金利受取 / 変動金利支払	403,757	367,932	12,358	12,358	356,363	332,801	13,083	13,083		
固定金利支払 / 変動金利受取	3,000	3,000	362	362	3,000	3,000	404	404		
合 計				11,995						12,679

(ご参考)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								
想定元本	35,825	104,676	232,175	19,500	11,581		403,757	
変動金利支払								
平均受取金利	0.98	1.99	1.35	1.73	1.01		1.49	
スワップ								
平均支払金利	0.31	0.62	0.17	0.28	0.19		0.31	
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			0.15				0.15	
スワップ								
平均支払金利			3.13				3.13	

(単位:百万円、%)

区 分	平成12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								
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	

