

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)

(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	113				787
合 計	11,995	36,356				24,360

(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	8,495				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。

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13年度末				平成12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	403,757	367,932	12,358	12,358	356,363	332,801	13,083	13,083
頭 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 変動金利支払 スワップ	想定元本	35,825	104,676	232,175	19,500	11,581		403,757
	平均受取金利	0.98	1.99	1.35	1.73	1.01		1.49
	平均支払金利	0.31	0.62	0.17	0.28	0.19		0.31
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			0.15				0.15
	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 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								
為替予約								
売建	583,306		619,663	36,356	56,160		64,656	8,495
米ドル	544,379		580,701	36,322	28,595		33,413	4,818
ユーロ	30,050		30,052	1	19,857		22,393	2,535
ポンド	8,876		8,909	32	7,707		8,849	1,141
買建								
頭								
合 計				36,356				8,495

(注) 外貨建金銭債権債務等に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。

d.株式関連(ヘッジ会計適用分・非適用分の合算値)

平成13年度末、平成12年度末とも保有していません。

e.債券関連(ヘッジ会計適用分・非適用分の合算値)

平成13年度末、平成12年度末とも保有していません。