

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	12,235	432				11,803
ヘッジ会計非適用分	1,070	485				1,556
合 計	13,306	53				13,359

(単位:百万円)

区 分	平成12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	4,688					4,688
ヘッジ会計非適用分	34	10				24
合 計	4,723	10				4,713

(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おります。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13年度上半期末				平成12年度上半期末			
	契約額等	時価		差損益	契約額等	時価		差損益
		1年超				1年超		
店 金利スワップ								
固定金利受取 / 変動金利支払	344,301	316,718	13,703	13,703	423,302	367,801	5,603	5,603
頭 固定金利支払 / 変動金利受取	3,000	3,000	396	396	32,000	32,000	879	879
合 計				13,306				4,723

種 類	平成12年度末			
	契約額等	時価		差損益
		1年超		
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
頭 固定金利支払 / 変動金利受取	3,000	3,000	404	404
合 計				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	27,583	114,418	159,800	39,500	3,000		344,301
	平均受取金利	1.16	2.11	1.56	1.78	2.40		1.74
	平均支払金利	0.35	0.58	0.14	0.14	0.88		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			0.14				0.14
	平均支払金利			3.13				3.13

(単位:百万円、%)

区 分		平成12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	55,501	67,010	136,791	157,000	7,000		423,302
	平均受取金利	2.85	1.11	1.90	1.86	1.95		1.88
	平均支払金利	0.89	0.56	0.67	0.50	0.66		0.62
固定金利支払 変動金利受取 スワップ	想定元本				3,000	29,000		32,000
	平均受取金利				0.36			0.03
	平均支払金利				3.13	2.55		2.60

(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年度上半期末				平成12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			
店 頭	為替予約								
	売建	158,270		158,707	437	5,360		5,370	10
	米ドル	156,466		156,899	432	5,360		5,370	10
	ユーロ	1,803		1,808	5				
	ポンド								
	買建	29,394		29,884	490				
	米ドル	26,869		27,239	370				
	ユーロ	2,524		2,645	120				
ポンド									
合 計				53					10

種 類	平成12年度末				
	契約額等		時価	差損益	
		うち1年超			
店 頭	為替予約				
	売建	56,160		64,656	8,495
	米ドル	28,595		33,413	4,818
	ユーロ	19,857		22,393	2,535
	ポンド	7,707		8,849	1,141
	買建				
	米ドル				
	ユーロ				
ポンド					
合 計				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13年度上半期末、平成12年度上半期末および平成12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13年度上半期末、平成12年度上半期末および平成12年度末とも保有しておりません。