

#### 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	488	64	5		1,500
合 計	13,306	55	64	5		13,303

(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	0	141	127		234
合 計	4,723	0	141	127		4,454

(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。

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
店 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
店 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	27,583	114,418	159,800	39,500	3,000		344,301	
変動金利支払	1.16	2.11	1.56	1.78	2.40		1.74	
スワップ	0.35	0.58	0.14	0.14	0.88		0.31	
固定金利支払			3,000				3,000	
変動金利受取			0.14				0.14	
スワップ			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	55,501	67,010	136,791	157,000	7,000		423,302	
変動金利支払	2.85	1.11	1.90	1.86	1.95		1.88	
スワップ	0.89	0.56	0.67	0.50	0.66		0.62	
固定金利支払				3,000	29,000		32,000	
変動金利受取				0.36			0.03	
スワップ				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	23,562	93,508	187,793	48,500	3,000		356,363	
変動金利支払	1.72	1.57	1.83	1.73	2.40		1.75	
スワップ	0.71	0.54	0.57	0.37	1.34		0.55	
固定金利支払				3,000			3,000	
変動金利受取				0.56			0.56	
スワップ				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			
為替予約										
店 売建	160,544		160,987	442	12,242		12,265	22		
頭 米ドル	158,307		158,745	437	9,360		9,368	8		
ユーロ	1,850		1,855	4	1,672		1,686	14		
債券	290		290	0	302		302	0		
その他	96		96	0	907		908	0		
買建	32,222		32,720	497	7,536		7,559	22		
米ドル	29,171		29,546	375	6,096		6,112	16		
ユーロ	357		359	2	273		273	0		
債券	2,589		2,709	120	856		862	5		
その他	103		104	0	309		309	0		
合 計				55				0		

種 類	平成12年度末				
	契約額等			時価	差損益
		うち1年超			
為替予約					
店 売建	56,258		64,755	8,497	
頭 米ドル	28,692		33,512	4,819	
ユーロ	19,857		22,393	2,535	
債券	7,707		8,849	1,141	
買建	140		148	8	
米ドル	140		148	8	
ユーロ					
債券					
合 計				8,488	

(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			
取 株価指数先物										
引 売建	972		1,015	42						
所 買建	32		30	2	7,689		7,570	118		
外国株価指数先物										
売建										
買建	237		218	19	415		392	22		
合 計				64				141		

種 類	平成12年度末				
	契約額等			時価	差損益
		うち1年超			
取 株価指数先物					
引 売建					
所 買建	254		280	25	
外国株価指数先物					
売建					
買建					
合 計				25	

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			
取 債券先物										
引 売建	1,400		1,395	5	11,129		11,256	127		
所 買建										
合 計				5				127		

種 類	平成12年度末				
	契約額等			時価	差損益
		うち1年超			
取 債券先物					
引 売建					
所 買建	3,069		3,058	11	
合 計				11	