

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14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 | 10,136 | 1,540 | — | — | — | 11,677 |
| ヘッジ会計非適用分 | 542 | △99 | — | — | — | 443 |
| 合 計 | 10,679 | 1,441 | — | — | — | 12,120 |

(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 |

(注) ヘッジ会計適用分のうち時価ヘッジ適用分の差損益(平成14年度末:通貨関連1,540万円、平成13年度末:通貨関連△36,242百万円)、およびヘッジ会計非適用分の差損益は、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)

| 店 区 分 | 平成14年度末 | | | | 平成13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 | | |
| 金利スワップ | | | | | | | | |
| 固定金利受取/変動金利支払 | 368,978 | 318,295 | 10,984 | 10,984 | 403,757 | 367,932 | 12,358 | 12,358 |
| 固定金利支払/変動金利受取 | 3,000 | 3,000 | △305 | △305 | 3,000 | 3,000 | △362 | △362 |
| 合 計 | | | | 10,679 | | | | 11,995 |

【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14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 | 50,683 | 209,918 | 93,750 | 4,000 | 10,627 | — | 368,978 | |
| 変動金利支払 | | | | | | | | |
| 平均受取金利 | 2.06 | 1.56 | 1.29 | 2.13 | 1.02 | — | 1.55 | |
| スワップ | | | | | | | | |
| 平均支払金利 | 0.34 | 0.30 | 0.23 | 0.79 | 0.16 | — | 0.29 | |
| 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 | — | — | 0.13 | — | — | — | 0.13 | |
| スワップ | | | | | | | | |
| 平均支払金利 | — | — | 3.13 | — | — | — | 3.13 | |

(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 | |

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)

| 区 分 | 平成14年度末 | | | | 平成13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 | 180,722 | — | 179,387 | 1,334 | 583,306 | — | 619,663 | △36,356 |
| | 米ドル | 157,144 | — | 155,663 | 1,480 | 544,379 | — | 580,701 | △36,322 |
| | ユーロ | 23,578 | — | 23,724 | △145 | 30,050 | — | 30,052 | △1 |
| | 英ポンド | — | — | — | — | 8,876 | — | 8,909 | △32 |
| | 買建 | 46,197 | — | 46,303 | 106 | — | — | — | — |
| 頭 | 米ドル | 36,727 | — | 36,716 | △10 | — | — | — | — |
| | ユーロ | 9,470 | — | 9,586 | 116 | — | — | — | — |
| 合 計 | | | | | 1,441 | | | | △36,356 |

(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14年度末、平成13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14年度末、平成13年度末とも保有していません。