

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14年度上半期末					
	金利関連	通貨関連	株式関連	債券関連	その他	合計
ヘッジ会計適用分	11,203	170	—	—	—	11,374
ヘッジ会計非適用分	718	8	△19	—	—	707
合 計	11,922	179	△19	—	—	12,082

(単位:百万円)

区 分	平成13年度上半期末					
	金利関連	通貨関連	株式関連	債券関連	その他	合計
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13年度末					
	金利関連	通貨関連	株式関連	債券関連	その他	合計
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

(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年度上半期末:通貨関連170百万円、平成13年度上半期末:通貨関連△432百万円、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。

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14年度上半期末				平成13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 金利スワップ								
頭 固定金利受取/変動金利支払	385,699	349,272	12,263	12,263	344,301	316,718	13,703	13,703
固定金利支払/変動金利受取	3,000	3,000	△340	△340	3,000	3,000	△396	△396
合 計				11,922				13,306

種 類	平成13年度末			
	契約額等	時価		差損益
		うち1年超		
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
固定金利支払/変動金利受取	3,000	3,000	△362	△362
合 計				11,995

(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14年度上半期末						
		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	合計
固定金利受取 変動金利支払 スワップ	想定元本	36,427	125,791	204,375	8,000	11,106	—	385,699
	平均受取金利	1.10	1.93	1.36	1.87	1.02	—	1.52
	平均支払金利	0.24	0.53	0.14	0.49	0.17	—	0.29
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	—	—	0.13	—	—	—	0.13
	平均支払金利	—	—	3.13	—	—	—	3.13

(単位:百万円、%)

区 分		平成13年度上半期末						
		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	合計
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13年度末						
		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	合計
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

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14年度上半期末				平成13年度上半期末			
	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
為替予約								
店 売建	153,158	—	152,988	170	160,544	—	160,987	△442
米ドル	152,730	—	152,558	172	158,307	—	158,745	△437
ユーロ	236	—	238	△1	1,850	—	1,855	△4
店 ポンド	191	—	191	△0	290	—	290	0
その他	—	—	—	—	96	—	96	0
頭 買建	541	—	551	9	32,222	—	32,720	497
米ドル	269	—	273	3	29,171	—	29,546	375
ユーロ	272	—	277	5	357	—	359	2
店 ポンド	—	—	—	—	2,589	—	2,709	120
その他	—	—	—	—	103	—	104	0
合 計				179				55

種 類	平成13年度末			
	契約額等	うち1年超	時価	差損益
為替予約				
店 売建	584,060	—	620,416	△36,356
米ドル	545,119	—	581,441	△36,322
ユーロ	30,064	—	30,066	△1
店 ポンド	8,876	—	8,909	△32
その他	—	—	—	—
頭 買建	713	—	719	6
米ドル	567	—	573	6
ユーロ	13	—	13	0
店 ポンド	132	—	132	△0
その他	—	—	—	—
合 計				△36,350

(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います。

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14年度上半期末				平成13年度上半期末			
	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
株価指数先物								
取 売建	3,375	—	3,376	△1	972	—	1,015	△42
引 買建	—	—	—	—	32	—	30	△2
所 外国株価指数先物								
売建	—	—	—	—	—	—	—	—
引 買建	192	—	173	△18	237	—	218	△19
合 計				△19				△64

種 類	平成13年度末			
	契約額等	うち1年超	時価	差損益
株価指数先物				
取 売建	—	—	—	—
引 買建	10	—	10	0
所 外国株価指数先物				
売建	—	—	—	—
引 買建	2,712	—	2,708	△4
合 計				△4

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			
	契約額等	うち1年超	時価	差損益
債券先物				
取 売建	1,400	—	1,395	5
引 買建	—	—	—	—
合 計				5

(注) 平成14年度上半期末、平成13年度末は保有していません。