

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15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	6,285	7,143	—	—	—	13,429
ヘッジ会計非適用分	349	△17	△8	—	—	323
合 計	6,635	7,126	△8	—	—	13,753

（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14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	10,136	1,540	—	—	—	11,677
ヘッジ会計非適用分	542	△106	—	—	—	436
合 計	10,679	1,434	—	—	—	12,113

（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15年度上半期末：通貨関連7,143百万円、平成14年度上半期末：通貨関連170百万円、平成14年度末：通貨関連1,540百万円）、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）

区 分		平成15年度上半期末				平成14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	350,309	276,318	6,880	6,880	385,699	349,272	12,263	12,263
	固定金利支払／変動金利受取	3,000	3,000	△245	△245	3,000	3,000	△340	△340
合 計					6,635				11,922

（単位：百万円）

区 分		平成14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	368,978	318,295	10,984	10,984
	固定金利支払／変動金利受取	3,000	3,000	△305	△305
合 計					10,679

【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15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	想定元本	73,991	202,425	60,750	3,000	10,143	—	350,309
変動金利支払	平均受取金利	2.31	1.35	1.46	2.40	1.02	—	1.57
スワップ	平均支払金利	0.76	0.14	0.22	0.87	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	—	0.12	—	—	—	—	0.12
スワップ	平均支払金利	—	3.13	—	—	—	—	3.13

（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	想定元本	36,427	125,791	204,375	8,000	11,106	—	385,699
変動金利支払	平均受取金利	1.10	1.93	1.36	1.87	1.02	—	1.52
スワップ	平均支払金利	0.24	0.53	0.14	0.49	0.17	—	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14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	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

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)

区 分		平成15年度上半期末				平成14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	146,796	—	139,665	7,130	153,158	—	152,988	170
	米ドル	146,041	—	138,902	7,139	152,730	—	152,558	172
	ユーロ	559	—	566	△6	236	—	238	△1
	英ポンド	23	—	23	△0	191	—	191	△0
	その他	171	—	172	△1	—	—	—	—
	買建	4,477	—	4,473	△4	541	—	551	9
	米ドル	1,725	—	1,698	△27	269	—	273	3
	ユーロ	2,330	—	2,350	19	272	—	277	5
	英ポンド	—	—	—	—	—	—	—	—
	その他	422	—	424	2	—	—	—	—
合 計					7,126				179

(単位:百万円)

区 分		平成14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	181,049	—	179,718	1,331
	米ドル	157,287	—	155,808	1,479
	ユーロ	23,710	—	23,858	△148
	英ポンド	—	—	—	—
	その他	51	—	52	△0
	買建	47,319	—	47,422	103
	米ドル	37,520	—	37,501	△18
	ユーロ	9,747	—	9,868	121
	英ポンド	—	—	—	—
	その他	51	—	52	0
合 計					1,434

(注) 外貨建金銭債権債務等にて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)

区 分		平成15年度上半期末				平成14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		
取引所	株価指数先物								
	売建	—	—	—	—	3,375	—	3,376	△1
	買建	210	—	203	△7	—	—	—	—
	外国株価指数先物								
	売建	—	—	—	—	—	—	—	—
合 計	買建	112	—	111	△1	192	—	173	△18
合 計					△8				△19

(注) 平成14年度末は保有していません。

オ. 債券関連(ヘッジ会計適用分・非適用分の合算値)

平成15年度上半期末、平成14年度上半期末および平成14年度末とも保有していません。