

## (2) 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	△3,000	7,043	—	—	—	4,043
ヘッジ会計非適用分	413	202	—	—	—	615
合 計	△2,586	7,245	—	—	—	4,659

(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

(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年度末:通貨関連7,043百万円、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年度末				平成14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 頭	金利スワップ									
	固定金利受取/変動金利支払	316,324	261,331	5,614	5,614	368,978	318,295	10,984	10,984	
	固定金利支払/変動金利受取	103,000	103,000	△8,527	△8,527	3,000	3,000	△305	△305	
	変動金利支払/変動金利受取	60,000	55,000	326	326	—	—	—	—	
合 計				△2,586					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	54,993	230,175	21,500	9,656	—	—	316,324
	平均受取金利	1.93	1.35	1.77	1.02	—	—	1.47
	平均支払金利	0.84	0.14	0.40	0.15	—	—	0.28
固定金利支払 変動金利受取 スワップ	想定元本	—	3,000	—	—	—	100,000	103,000
	平均受取金利	—	0.12	—	—	—	1.25	1.21
	平均支払金利	—	3.13	—	—	—	3.57	3.56
変動金利支払 変動金利受取 スワップ	想定元本	5,000	55,000	—	—	—	—	60,000
	平均受取金利	0.18	0.62	—	—	—	—	0.59
	平均支払金利	0.06	0.43	—	—	—	—	0.40

(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 変動金利支払 スワップ	想定元本	50,683	209,918	93,750	4,000	10,627	—	368,978
	平均受取金利	2.06	1.56	1.29	2.13	1.02	—	1.55
	平均支払金利	0.34	0.30	0.23	0.79	0.16	—	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
変動金利支払 変動金利受取 スワップ	想定元本	—	—	—	—	—	—	—
	平均受取金利	—	—	—	—	—	—	—
	平均支払金利	—	—	—	—	—	—	—

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年度末				平成14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		
店	為替予約								
	売建	452,760	—	445,514	7,245	180,722	—	179,387	1,334
	米ドル	452,760	—	445,514	7,245	157,144	—	155,663	1,480
頭	ユーロ	—	—	—	—	23,578	—	23,724	△145
	買建	—	—	—	—	46,197	—	46,303	106
	米ドル	—	—	—	—	36,727	—	36,716	△10
	ユーロ	—	—	—	—	9,470	—	9,586	116
合 計					7,245				1,441

エ. 株式関連(ヘッジ会計適用分・非適用分の合算値)

平成15年度末、平成14年度末とも保有していません。

オ. 債券関連(ヘッジ会計適用分・非適用分の合算値)

平成15年度末、平成14年度末とも保有していません。