

4. デリバティブ取引の定量的情報

(1) 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	187	24	—	—	625
合 計	△2,586	7,231	24	—	—	4,669

(単位:百万円)

区 分	平成16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	△5,563	△4,788	—	—	—	△10,351
ヘッジ会計非適用分	—	△2	△7	—	—	△9
合 計	△5,563	△4,790	△7	—	—	△10,361

(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16年度末:通貨関連△4,788百万円)、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。

(2) 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 頭	区 分	平成15年度末				平成16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	316,324	261,331	5,614	5,614	307,357	152,932	3,590	3,590
	固定金利支払/変動金利受取	103,000	103,000	△8,527	△8,527	103,000	103,000	△9,153	△9,153
	変動金利支払/変動金利受取	60,000	55,000	326	326	—	—	—	—
	合 計				△2,586				△5,563

【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16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	154,425	97,033	22,630	19,668	13,600	—	307,357
	平均受取金利	1.44	1.26	1.03	1.00	1.25	—	1.32
	平均支払金利	0.11	0.26	0.36	0.08	0.17	—	0.18
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	—	0.07	—	—	—	1.25	1.22
	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	—	—	—	—	—	—	—
	平均受取金利	—	—	—	—	—	—	—
	平均支払金利	—	—	—	—	—	—	—

(3)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16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	為替予約								
	売建	452,760	—	445,514	7,245	214,391	—	219,210	△4,819
	米ドル	452,760	—	445,514	7,245	202,122	—	206,903	△4,780
	ユーロ	—	—	—	—	10,736	—	10,770	△34
	英ポンド	—	—	—	—	892	—	898	△5
	その他	—	—	—	—	639	—	637	1
	買建	301	—	286	△14	6,273	—	6,301	28
	米ドル	244	—	231	△13	1,881	—	1,891	9
	ユーロ	—	—	—	—	2,661	—	2,668	7
	英ポンド	20	—	20	△0	1,637	—	1,648	10
	その他	36	—	34	△1	92	—	93	0
	合 計					7,231			

(注) 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、貸借対照表において当該円貨額で表示されている外貨建金銭債権債務等にかかる取引を除いています。

(4)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年度末				平成16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
取 引 所	株価指数先物								
	買建	452	—	471	19	951	—	944	△6
	外国株価指数先物								
	買建	228	—	234	5	836	—	835	△0
合 計					24				△7

(5)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16年度末とも保有していません。