

#### 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年度上半期末					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	△1,403	7,143	—	—	—	5,739
ヘッジ会計非適用分	646	5,940	△1,652	—	—	4,933
合 計	△757	13,083	△1,652	—	—	10,673

(単位:百万円)

区 分	平成16年度上半期末					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	△2,910	△6,663	—	—	—	△9,573
ヘッジ会計非適用分	—	7	△19	0	—	△11
合 計	△2,910	△6,655	△19	0	—	△9,584

(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

(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16年度上半期末:通貨関連△6,663百万円、平成15年度末:通貨関連7,043百万円)、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)

区 分	平成15年度上半期末				平成16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
店 金利スワップ								
店 固定金利受取/変動金利支払	350,309	276,318	6,880	6,880	307,011	237,211	4,536	4,536
店 固定金利支払/変動金利受取	173,000	103,000	△7,934	△7,934	103,000	103,000	△7,446	△7,446
店 変動金利支払/変動金利受取	60,000	55,000	296	296	—	—	—	—
合 計				△757				△2,910

(単位:百万円)

区 分	平成15年度末			
	契約額等	うち1年超	時価	差損益
店 金利スワップ				
店 固定金利受取/変動金利支払	316,324	261,331	5,614	5,614
店 固定金利支払/変動金利受取	103,000	103,000	△8,527	△8,527
店 変動金利支払/変動金利受取	60,000	55,000	326	326
合 計				△2,586

##### 【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						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	73,991	202,425	60,750	3,000	10,143	—	350,309
	平均受取金利	2.31	1.35	1.46	2.40	1.02	—	1.57
変動金利支払 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	70,000	3,000	—	—	—	100,000	173,000
変動金利受取 スワップ	平均受取金利	0.72	0.12	—	—	—	1.26	1.02
	平均支払金利	1.84	3.13	—	—	—	3.57	2.86
変動金利支払 スワップ	想定元本	5,000	55,000	—	—	—	—	60,000
	平均受取金利	0.30	0.77	—	—	—	—	0.73
	平均支払金利	0.07	0.45	—	—	—	—	0.42

(単位:百万円、%)

区 分		平成16年度上半期末						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	69,800	190,266	26,280	19,665	1,000	—	307,011
	平均受取金利	1.29	1.37	1.23	0.99	1.18	—	1.32
変動金利支払 スワップ	平均支払金利	0.15	0.14	0.39	0.14	0.22	—	0.17
	固定金利支払	—	3,000	—	—	—	100,000	103,000
変動金利受取 スワップ	平均受取金利	—	0.11	—	—	—	1.25	1.21
	平均支払金利	—	3.13	—	—	—	3.57	3.56
変動金利支払 スワップ	想定元本	—	—	—	—	—	—	—
	平均受取金利	—	—	—	—	—	—	—
	平均支払金利	—	—	—	—	—	—	—

(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	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
変動金利支払 スワップ	平均支払金利	0.84	0.14	0.40	0.15	—	—	0.28
	固定金利支払	—	3,000	—	—	—	100,000	103,000
変動金利受取 スワップ	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 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

## (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年度上半期末				平成16年度上半期末				平成15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	契約額等	うち1年超		時価	差損益
店															
為替予約															
売建	262,239	-	249,921	12,317	429,408	-	436,070	△6,661		452,760	-	445,514	7,245		
米ドル	240,791	-	228,702	12,088	429,139	-	435,802	△6,662		452,760	-	445,514	7,245		
ユーロ	21,252	-	21,021	231	118	-	118	0		-	-	-	-		
スイスフラン	11	-	11	△0	-	-	-	-		-	-	-	-		
英ポンド	23	-	23	△0	92	-	92	0		-	-	-	-		
その他	160	-	161	△1	57	-	56	0		-	-	-	-		
買建	6,958	-	6,956	△1	12,233	-	12,239	6		301	-	286	△14		
米ドル	4,206	-	4,182	△24	8,535	-	8,520	△15		244	-	231	△13		
ユーロ	2,330	-	2,350	19	379	-	384	5		-	-	-	-		
スイスフラン	125	-	127	2	98	-	98	△0		36	-	34	△1		
英ポンド	-	-	-	-	3,219	-	3,236	16		20	-	20	△0		
その他	296	-	296	△0	0	-	0	△0		-	-	-	-		
通貨オプション															
売建															
コール	25,256	-	-	-	-	-	-	-		-	-	-	-		
(161)			28	132	(-)	-	-	-		(-)	-	-	-		
米ドル	25,256	-	-	-	-	-	-	-		-	-	-	-		
(161)			28	132	(-)	-	-	-		(-)	-	-	-		
ユーロ	-	-	-	-	-	-	-	-		-	-	-	-		
(-)			-	-	(-)	-	-	-		(-)	-	-	-		
プット	-	-	-	-	-	-	-	-		-	-	-	-		
(-)			-	-	(-)	-	-	-		(-)	-	-	-		
買建															
コール	-	-	-	-	-	-	-	-		-	-	-	-		
(-)			-	-	(-)	-	-	-		(-)	-	-	-		
プット	24,201	-	949	634	(-)	-	-	-		(-)	-	-	-		
(315)			949	634	(-)	-	-	-		(-)	-	-	-		
米ドル	24,201	-	-	-	-	-	-	-		(-)	-	-	-		
(315)			949	634	(-)	-	-	-		(-)	-	-	-		
ユーロ	-	-	-	-	-	-	-	-		(-)	-	-	-		
(-)			-	-	(-)	-	-	-		(-)	-	-	-		
頭															
合 計				13,083				△6,655							7,231

(注) 1.( )内には、貸借対照表に計上したオプション料を記載しています。

2. 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については、開示の対象より除いています。

## (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年度上半期末				平成16年度上半期末				平成15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	契約額等	うち1年超		時価	差損益
取															
引															
所															
株価指数先物															
売建	-	-	-	-	-	-	-	-		-	-	-	-		
買建	210	-	203	△7	491	-	474	△16		452	-	471	19		
外国株価指数先物															
売建	-	-	-	-	-	-	-	-		-	-	-	-		
買建	112	-	111	△1	309	-	307	△2		228	-	234	5		
株価指数オプション															
売建															
コール	-	-	-	-	-	-	-	-		-	-	-	-		
(-)			-	-	(-)	-	-	-		(-)	-	-	-		
プット	-	-	-	-	-	-	-	-		-	-	-	-		
(-)			-	-	(-)	-	-	-		(-)	-	-	-		
買建															
コール	-	-	-	-	-	-	-	-		-	-	-	-		
(-)			-	-	(-)	-	-	-		(-)	-	-	-		
プット	107,460	-	1,687	△1,643	(-)	-	-	-		(-)	-	-	-		
(3,331)			1,687	△1,643	(-)	-	-	-		(-)	-	-	-		
合 計				△1,652				△19							24

(注) ( )内には、貸借対照表に計上したオプション料を記載しています。

## (5) 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)

区 分	平成15年度上半期末				平成16年度上半期末				平成15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	契約額等	うち1年超		時価	差損益
取															
引															
所															
債券指数先物															
売建	-	-	-	-	-	-	-	-		-	-	-	-		
買建	-	-	-	-	-	-	-	-		-	-	-	-		
外国債券指数先物															
売建	-	-	-	-	-	-	-	-		-	-	-	-		
買建	-	-	-	-	88	-	88	0		-	-	-	-		
合 計				-				0							