

5. デリバティブ取引の時価情報（一般勘定）（ヘッジ会計適用・非適用分の合算値）

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						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	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	1,198	103,079	-	-	-	104,278	2,997	46,890	-	-	-	43,893
ヘッジ会計非適用分	2,354	5,519	734	7	25	7,158	7,354	4,102	20	5,540	8	8,821
合 計	3,553	108,599	734	7	25	111,436	10,351	50,993	20	5,540	8	35,072

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	2,746	53,282	-	-	-	50,536
ヘッジ会計非適用分	6,993	5,135	-	381	20	2,260
合 計	9,739	58,418	-	381	20	48,276

（注）上表のうち損益計算書に計上されている金額は以下のとおりです。

平成15年度上半期末：ヘッジ会計適用分のうち時価ヘッジ適用分の差損益（通貨関連103,079百万円）及びヘッジ会計非適用分のうちヘッジ会計の中止に伴う繰延ヘッジ損益の未償却額を除いた差損益（7,158百万円）の合計110,238百万円

平成14年度上半期末：ヘッジ会計適用分のうち時価ヘッジ適用分の差損益（通貨関連 46,890百万円）及びヘッジ会計非適用分の差損益（8,821百万円）の合計 38,069百万円
平成14年度末：ヘッジ会計適用分のうち時価ヘッジ適用分の差損益（通貨関連 53,282百万円）及びヘッジ会計非適用分の差損益（2,260百万円）の合計 51,022百万円

時価情報

（a）金利関連

（単位：百万円）

区 分	種 類	平成15年度上半期末					平成14年度上半期末					平成14年度末				
		契約額等		時価	差損益	うちヘッジ会計適用分	契約額等		時価	差損益	うちヘッジ会計適用分	契約額等		時価	差損益	うちヘッジ会計適用分
		うち1年超					うち1年超					うち1年超				
取 引 所	金利先物															
	売建	-	-	-	-	52,428	-	52,445	17	-	-	-	-	-	-	-
	買建	-	-	-	-	65,157	17,473	65,163	5	-	-	-	-	-	-	-
店 頭	海外金利先物															
	買建	-	-	-	-	180,553	99,726	182,128	1,575	-	169,383	140,171	170,491	1,108	-	-
店 頭	金利スワップ															
	固定金利受取 / 変動金利支払	445,456	403,178	3,927	3,927	1,198	479,316	408,447	10,361	10,361	2,997	449,559	382,590	9,365	9,365	2,746
	固定金利支払 / 変動金利受取	202,400	66,800	374	374	-	458,900	316,400	1,573	1,573	-	342,900	202,400	733	733	-
	合 計				3,553	1,198				10,351	2,997				9,739	2,746

（注）差損益欄には、先物取引については契約額と時価との差額を記載し、スワップ取引については時価を記載しています。

（参考）金利スワップ残存期間別残高

（単位：百万円、%）

区 分	1年以下	1年超	3年超	5年超	7年超	10年超	合計
		3年以下	5年以下	7年以下	10年以下		
平成15年度上半期末	受取側固定スワップ想定元本	42,278	263,940	127,730	4,000	3,500	445,456
	平均受取固定金利	1.61	1.04	0.62	0.70	0.60	0.97
	平均支払変動金利	0.07	0.07	0.07	0.07	0.07	0.07
	支払側固定スワップ想定元本	135,600	66,800	-	-	-	202,400
	平均支払固定金利	0.25	0.36	-	-	-	0.29
	平均受取変動金利	0.07	0.07	-	-	-	0.07
合 計	177,878	330,740	127,730	4,000	3,500	4,008	647,856
平成14年度上半期末	受取側固定スワップ想定元本	70,869	150,271	253,176	5,000	-	479,316
	平均受取固定金利	1.15	1.65	0.68	0.71	-	1.05
	平均支払変動金利	0.08	0.08	0.08	0.08	-	0.08
	支払側固定スワップ想定元本	142,500	285,400	18,000	13,000	-	458,900
	平均支払固定金利	0.16	0.30	0.44	0.81	-	0.28
	平均受取変動金利	0.08	0.08	0.08	0.09	-	0.08
合 計	213,369	435,671	271,176	18,000	-	-	938,216
平成14年度末	受取側固定スワップ想定元本	66,969	132,460	245,130	5,000	-	449,559
	平均受取固定金利	1.21	1.66	0.59	0.71	-	1.00
	平均支払変動金利	0.08	0.07	0.07	0.08	-	0.07
	支払側固定スワップ想定元本	140,500	202,400	-	-	-	342,900
	平均支払固定金利	0.14	0.29	-	-	-	0.23
	平均受取変動金利	0.08	0.07	-	-	-	0.08
合 計	207,469	334,860	245,130	5,000	-	-	792,459

(b) 通貨関連

(単位: 百万円)

区 分	種 類	平成15年度上半期末				平成14年度上半期末				平成14年度末			
		契約額等	時価	差損益	うちヘッジ会計 適用分	契約額等	時価	差損益	うちヘッジ会計 適用分	契約額等	時価	差損益	うちヘッジ会計 適用分
	為替予約												
	売建	2,931,055	2,822,575	108,479	103,086	1,651,834	1,701,878	50,044	46,890	2,664,722	2,722,382	57,659	53,282
	(米ドル)	1,650,815	1,574,916	75,898	74,418	754,859	769,816	14,957	13,978	1,369,656	1,396,599	26,943	25,233
	(ユーロ)	1,096,570	1,067,008	29,562	26,032	702,839	729,349	26,509	24,801	1,028,060	1,056,281	28,220	25,908
	(英ポンド)	92,944	91,016	1,927	1,632	89,033	94,329	5,295	4,938	154,719	154,783	63	82
	(スウェーデン・クローナ)	44,666	44,705	39	113	58,728	61,117	2,388	2,312	62,394	63,835	1,441	1,327
	(加ドル)	37,407	36,297	1,110	1,093	38,671	39,426	755	721	35,020	35,908	887	859
	(豪ドル)	8,651	8,630	20	23	7,700	7,839	138	137	14,868	14,970	102	35
	(シンガポール・ドル)	0	0	0	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	(香港ドル)	-	-	-	-	-	-	-	-	3	3	0	-
店	買建	61,941	60,120	1,821	6	233,373	233,318	55	0	439,013	438,851	161	-
	(ユーロ)	36,458	35,509	949	6	110,505	109,999	506	0	167,597	167,157	440	-
	(米ドル)	22,298	21,402	895	-	88,463	88,694	231	-	202,956	203,290	334	-
	(英ポンド)	1,825	1,815	9	-	28,455	28,674	219	-	57,546	57,565	19	-
	(スウェーデン・クローナ)	951	977	25	-	3,931	3,949	18	-	-	-	-	-
	(豪ドル)	387	394	7	-	2,018	1,999	18	-	10,912	10,837	74	-
	(香港ドル)	20	20	0	-	-	-	-	-	-	-	-	-
頭	通貨オプション												
	売建												
	コール	6,459	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	(74)		2	71	-	(-)	-	-	-	(-)	-	-	-
	(ユーロ)	6,459	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	(74)		2	71	-	(-)	-	-	-	(-)	-	-	-
	買建												
	コール	6,459	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	(46)		1	45	-	(-)	-	-	-	(-)	-	-	-
	(ユーロ)	6,459	-	-	-	-	-	-	-	(-)	-	-	-
	(46)		1	45	-	(-)	-	-	-	(-)	-	-	-
	プット	286,262	-	-	-	150,024	-	-	-	304,979	-	-	-
	(951)		2,865	1,914	-	(1,000)	106	893	-	(693)	96	596	-
	(米ドル)	180,714	-	-	-	93,077	-	-	-	187,872	-	-	-
	(581)		2,429	1,847	-	(835)	100	735	-	(588)	94	493	-
	(ユーロ)	105,548	-	-	-	56,947	-	-	-	117,106	-	-	-
	(369)		436	66	-	(165)	6	158	-	(104)	1	103	-
	合 計			108,599	103,079			50,993	46,890			58,418	53,282

- (注) 1. 括弧内には、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. 各期末の為替相場は先物相場を使用しています。
3. 為替予約等により決済時における円貨額が確定しており、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係る当該為替予約等は、開示の対象より除いています。
4. 差損益欄には、先渡取引については契約額と時価との差額を記載し、オプション取引についてはオプション料と時価との差額を記載しています。
5. 上表において、残存期間1年超の取引はありません。

(c) 株式関連

(単位: 百万円)

区 分	種 類	平成15年度上半期末				平成14年度上半期末				平成14年度末			
		契約額等	時価	差損益	うちヘッジ会計 適用分	契約額等	時価	差損益	うちヘッジ会計 適用分	契約額等	時価	差損益	うちヘッジ会計 適用分
店	株価指数オプション												
	売建												
	コール	29,038	983	255	-	(-)	-	-	-	(-)	-	-	-
	(727)												
頭	買建												
	プット	24,840	249	478	-	(-)	-	-	-	(-)	-	-	-
	(727)												
	合 計			734	-			-	-			-	-

- (注) 1. 括弧内には、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. 差損益欄には、オプション料と時価との差額を記載しています。
3. 上表において、残存期間1年超の取引はありません。

(その他) 国内株式信用売

(単位: 百万円)

種 類	平成15年度上半期末				平成14年度上半期末				平成14年度末			
	契約額等	時価	差損益	うちヘッジ会計 適用分	契約額等	時価	差損益	うちヘッジ会計 適用分	契約額等	時価	差損益	うちヘッジ会計 適用分
国内株式信用売	-	-	-	-	193	173	20	-	-	-	-	-

- (注) 1. 差損益欄には、契約額と時価との差額を記載しています。
2. 上表において、残存期間1年超の取引はありません。

(d) 債券関連

(単位:百万円)

区分	種類	平成15年度上半期末				平成14年度上半期末				平成14年度末			
		契約額等	時価	差損益	うちヘッジ会計適用分	契約額等	時価	差損益	うちヘッジ会計適用分	契約額等	時価	差損益	うちヘッジ会計適用分
取引所	円建債券先物												
	売建	2,073	2,054	19	-	33,395	33,415	19	-	-	-	-	-
	買建	4,507	4,520	12	-	148,982	149,245	262	-	95,566	95,707	140	-
	外貨建債券先物												
	売建	-	-	-	-	60,786	62,665	1,878	-	44,268	44,153	114	-
	買建	-	-	-	-	358,579	365,110	6,530	-	30,397	30,514	116	-
	債券先物オプション												
	買建	-	-	-	-	9,700	-	-	-	-	-	-	-
	ブット	(-)	-	-	-	(23)	15	7	-	(-)	-	-	-
	外貨建債券先物オプション												
売建	-	-	-	-	48,119	-	-	-	-	-	-	-	
ブット	(-)	-	-	-	(464)	239	225	-	(-)	-	-	-	
買建	-	-	-	-	60,763	-	-	-	-	-	-	-	
コール	(-)	-	-	-	(621)	1,052	430	-	(-)	-	-	-	
店頭	債券店頭オプション												
	売建												
	コール	4,220				27,610				11,014			
	(66)	(66)	65	0	-	(35)	74	39	-	(38)	36	1	-
	ブット	28,416				23,396				37,024			
	(410)	(410)	598	188	-	(139)	127	12	-	(120)	81	38	-
	買建												
	コール	13,247				28,520				37,024			
	(149)	(149)	135	13	-	(126)	120	6	-	(76)	47	28	-
	ブット	4,220				27,610				11,014			
(80)	(80)	59	20	-	(123)	154	30	-	(65)	64	1	-	
外貨建債券店頭オプション													
買建													
コール	44,131				-				-				
(152)	(152)	335	182	-	(-)	-	-	-	(-)	-	-	-	
合計				7			5,540				381		

(注) 1.括弧内には、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.差損益欄には、先物取引については契約額と時価との差額を記載し、オプション取引についてはオプション料と時価との差額を記載しています。

3.上表において、残存期間1年超の取引はありません。

(e) その他

(単位:百万円)

区分	種類	平成15年度上半期末				平成14年度上半期末				平成14年度末			
		契約額等	時価	差損益	うちヘッジ会計適用分	契約額等	時価	差損益	うちヘッジ会計適用分	契約額等	時価	差損益	うちヘッジ会計適用分
店頭	クレジット・デフォルト・スワップ ブティック売建	1,000	25	25	-	1,000	8	8	-	1,000	20	20	-
合計		1,000	25	25	-	1,000	8	8	-	1,000	20	20	-

(注) 1.差損益欄には、時価を記載しています。

2.上表は、全て残存期間1年超の取引です。