

各 位

株式会社 新生銀行
東京都千代田区内幸町 2丁目 1番 8号四半期情報の開示について

当社の平成16年3月期第1四半期(平成15年4月1日から平成15年6月30日)における四半期情報について、お知らせいたします。

以下に掲げる四半期情報は、経済対策閣僚会議「改革先行プログラム」および金融庁「証券市場の構造改革プログラム」の趣旨等を踏まえ、任意の会社情報として開示するものです。

なお、以下に記載する数値は監査を受けておりません。

1. 金融再生法ベースの「カテゴリーによる開示」(単体)

(単位:億円)

	平成15年6月末 < * >	平成15年3月末 < >	増減 < - >
破産更生債権及びこれらに準ずる債権	323	357	-34
危険債権	1,049	990	59
要管理債権	680	984	-304
合 計	2,052	2,332	-280

* (注)平成15年6月末基準自己査定に基づく数値であります。

2. 自己資本比率 (国内基準)

【参考】

	平成15年9月末 < 予想値 >	平成15年3月末 < 実績 >
連結自己資本比率	20%程度	20.10%
連結 Tier 比率	14%程度	14.27%

(注)上記予想値は、経営環境に関する前提条件の変化等に伴い変動することがあります。

3. 預金・債券の状況 (単体)

(単位:億円)

	平成15年6月末 < >	平成15年3月末 < >	増減 < - >
預金・債券等(含む譲渡性預金)	40,969	44,913	-3,945
個人預金	15,377	14,733	644
うち定期性預金	11,450	11,151	298

4.時価情報

4.1. 時価のある『その他有価証券』の評価差額(単体)

(単位:億円)					【参考】 (単位:億円)			
	平成15年6月末*				平成15年3月末			
	時価	評価差額			時価	評価差額		
		うち益	うち損			うち益	うち損	
その他有価証券	14,377	239	304	64	16,462	235	333	98
株式	34	0	1	1	20	-2	0	2
債券	11,891	51	63	12	13,743	113	117	4
その他	2,452	188	240	51	2,699	124	216	92

* (注) 1.平成15年6月末の『評価差額』及び『含み損益』は、平成15年6月末時点の帳簿価額(償却原価法適用後、減損処理前)と時価との差額を計上しております。
2.当行は満期保有目的の債券は保有しておりません。

4.2 デリバティブ取引の評価損益(連結)

(1)金利関連取引

(単位:億円)					【参考】 (単位:億円)		
区分	種類	平成15年6月末			平成15年3月末		
		契約額等	時価	評価損益	契約額等	時価	評価損益
取引所	金利先物	2,270	-1	-1	344	-0	-0
	金利オプション	8,849	14	-0	-	-	-
店頭	金利スワップ	64,493	-124	-124	60,388	201	201
	金利オプション	29,992	21	35	18,532	23	34
	合計		-89	-90		224	235

(注) 1.ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引は、上記記載から除いております。
2.時価の算定
取引所取引につきましては、東京金融先物取引所等における最終の価格によっております。店頭取引につきましては、割引現在価値やオプション価格計算モデル等により算定しております。

(2)通貨関連取引

(単位:億円)					【参考】 (単位:億円)		
区分	種類	平成15年6月末			平成15年3月末		
		契約額等	時価	評価損益	契約額等	時価	評価損益
店頭	通貨スワップ	4,576	-31	-31	4,924	-25	-25

(注) 1.ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引および下記注3.の取引は、上記記載から除いております。
2.時価の算定
割引現在価値等により算定しております。
3.期間損益計算を行っている通貨スワップ取引の契約額等は、下記のとおりであります。
なお、従来、期間損益計算を行っていた通貨スワップ取引については、当四半期よりヘッジ会計を適用しておりますので、下記記載から除いております。

【参考】 (単位:億円)			
種類	平成15年3月末		
	契約額等	時価	評価損益
通貨スワップ	957	2	2

また、先物為替予約、通貨オプション等のうち、引き直しを行っている通貨関連のデリバティブ取引の契約額等は下記のとおりであります。なお、従来、引き直しを行っていた下記通貨関連のデリバティブ取引は、当四半期よりヘッジ会計を適用しておりますので、下記記載から除いております。

【参考】 (単位:億円)	
種類	平成15年3月末
	契約額等
為替予約	3,338
通貨オプション	1,115

(3) 株式関連取引

区分	種類	(単位: 億円)			【参考】 (単位: 億円)		
		平成15年6月末			平成15年3月末		
		契約額等	時価	評価損益	契約額等	時価	評価損益
取引所	株式指数先物	36	0	0	3	-0	-0
	株式指数オプション	108	6	-2	169	0	-0
	個別株オプション	10	1	-0	36	2	-0
店頭	有価証券店頭オプション	-	-	-	-	-	-
	有価証券店頭指数等スワップ	-	-	-	-	-	-
	その他	15	2	-2	1	0	-0
	合計		9	-4		2	-1

(注) 1. 上記取引については、時価評価を行っております。

2. 時価の算定

取引所取引につきましては、東京証券取引所等における最終の価格によっております。店頭取引につきましては、オプション価格計算モデル等により算定しております。

(4) 債券関連取引

区分	種類	(単位: 億円)			【参考】 (単位: 億円)		
		平成15年6月末			平成15年3月末		
		契約額等	時価	評価損益	契約額等	時価	評価損益
取引所	債券先物	963	6	6	215	0	0
	債券先物オプション	481	2	0	-	-	-

(注) 1. 上記取引については、時価評価を行っております。

2. 時価の算定は、東京証券取引所等における最終の価格によっております。

(5) 商品関連取引

該当ありません。

(6) クレジットデリバティブ取引

区分	種類	(単位: 億円)			【参考】 (単位: 億円)		
		平成15年6月末			平成15年3月末		
		契約額等	時価	評価損益	契約額等	時価	評価損益
店頭	クレジットデフォルトオプション	865	4	4	902	3	3

(注) 1. 上記取引については、時価評価を行っております。

2. 時価の算定

割引現在価値等により算定しております。

4.3 ヘッジ会計適用デリバティブ取引の状況 (連結)

[残存期間別想定元本]

	(単位: 億円)				【参考】 (単位: 億円)			
	平成15年6月末				平成15年3月末			
	1年以内	1年超 5年以内	5年超	合計	1年以内	1年超 5年以内	5年超	合計
金利スワップ 想定元本合計	526	2,377	2,230	5,133	3,430	4,427	2,905	10,763
受取固定・支払変動	476	2,006	67	2,549	2,975	2,580	146	5,703
受取変動・支払固定	30	371	2,163	2,564	435	1,847	2,758	5,040
受取変動・支払変動	20	-	-	20	20	-	-	20
通貨スワップ 想定元本合計	1,113	2,170	790	4,073	1,138	2,486	950	4,574