

(デリバティブ取引関係)

1. 当連結会計年度(平成15年3月31日現在)

(1) 金利関連取引

(金額単位 百万円)

区分	種 類	当連結会計年度(平成15年3月31日現在)			
		契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
		うち1年超			
取 引 所	金利先物				
	売建	59,749,099	4,547,691	103,623	103,623
	買建	57,633,988	5,676,922	109,474	109,474
	金利オプション				
売建	売建	1,230,739	-	76	76
	買建	600,964	205,802	99	99
店 頭	金利先渡契約				
	売建	13,389,231	590,000	1,076	1,076
	買建	3,469,855	455,000	500	500
	金利スワップ	305,031,482	214,079,553	250,498	250,498
	受取固定・支払変動	146,600,794	101,347,568	3,300,127	3,300,127
	受取変動・支払固定	139,298,388	98,710,883	3,040,142	3,040,142
	受取変動・支払変動	18,990,156	13,890,272	850	850
	金利スワップション				
	売建	1,720,503	798,669	35,707	35,707
	買建	1,523,512	1,106,731	26,355	26,355
	キャップ				
	売建	5,352,002	3,331,808	4,194	4,194
	買建	3,616,992	2,536,627	6,682	6,682
	フロアー				
	売建	317,281	207,279	7,673	7,673
	買建	351,199	195,322	9,027	9,027
	その他				
売建	42,316	36,551	6,526	6,526	
買建	250,660	92,669	6,603	6,603	
	合計			251,467	251,467

(注) 1. 上記取引については時価評価を行い、評価損益を連結損益計算書に計上しております。
 なお、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。
 また、一部の在外連結子会社において、現地の会計基準に従って処理している金利関連取引は、上記記載から除いております。なお、この未実現損益は827百万円(利益)であります。

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

(金額単位 百万円)

区分	種 類	当連結会計年度(平成15年3月31日現在)			
		契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
		うち1年超			
店 頭	通貨スワップ	16,433,656	8,831,238	39,389	39,389
	通貨スワップション				
	売建	330,238	330,238	3,173	3,173
	買建	865,005	865,005	13,724	13,724
	為替予約	2,935,846	547,699	1,518	1,518
	通貨オプション				
	売建	56,586	13,166	1,375	1,375
	買建	60,441	21,575	1,585	1,585
	その他				
	売建	15,310	2,855	153	153
買建	-	-	-	-	
	合計			26,956	26,956

(注) 1. 上記取引については時価評価を行い、評価損益を連結損益計算書に計上しております。
 なお、ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引及び下記注3.の取引は、上記記載から除いております。
 また、一部の在外連結子会社において、現地の会計基準に従って処理している通貨関連取引は、上記記載から除いております。なお、この未実現損益は 293百万円(損失)であります。

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. 先物為替予約、通貨オプション等のうち、連結会計年度末日に引直しを行い、その損益を連結損益計算書に計上しているもの、及び外貨建金銭債権債務等に付されたもので当該外貨建金銭債権債務等の連結貸借対照表表示に反映されているもの又は当該外貨建金銭債権債務等が連結手続上消去されたものについては、上記記載から除いております。

引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。

(金額単位 百万円)

区分	種類	当連結会計年度 (平成15年3月31日現在)	
		契約額等	
取引所	通貨先物		
	売建		-
	買建		-
	通貨オプション		
取引所	売建		-
	買建		-
店頭	為替予約	37,271,679	
	通貨オプション		
	売建		3,001,518
	買建		3,195,840

(3) 株式関連取引

(金額単位 百万円)

区分	種類	当連結会計年度(平成15年3月31日現在)			
		契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
取引所	株式指数先物				
	売建	-	-	-	-
	買建	-	-	-	-
	株式指数オプション				
取引所	売建	-	-	-	-
	買建	-	-	-	-
店頭	有価証券店頭オプション				
	売建	0	-	0	0
	買建	0	-	0	0
	有価証券店頭指数等スワップ				
	株価指数変化率受取・	-	-	-	-
	短期変動金利支払				
	短期変動金利受取・	-	-	-	-
	株価指数変化率支払				
	その他				
	売建	477	-	0	0
買建	477	-	0	0	
	合計			0	0

(注) 1. 上記取引については時価評価を行い、評価損益を連結損益計算書に計上しております。
 なお、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、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。

(4)債券関連取引

(金額単位 百万円)

区分	種 類	当連結会計年度(平成15年3月31日現在)			
		契約額等		時 価	評 価 損 益
		うち1年超			
取引所	債券先物				
	売建	119,032	-	388	388
	買建	129,712	-	67	67
	債券先物オプション				
	売建	4,000	-	8	8
	買建	-	-	-	-
店頭	債券店頭オプション				
	売建	16,010	15,617	0	0
	買建	4,719	3,125	0	0
	合計			463	463

- (注) 1. 上記取引については時価評価を行い、評価損益を連結損益計算書に計上しております。
 なお、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。

(5)商品関連取引

(金額単位 百万円)

区分	種 類	当連結会計年度(平成15年3月31日現在)			
		契約額等		時 価	評 価 損 益
		うち1年超			
店頭	商品スワップ				
	固定価格受取・ 変動価格支払	31,049	27,358	1,607	1,607
	変動価格受取・ 固定価格支払	31,049	27,358	2,376	2,376
	商品オプション				
	売建	6,369	4,063	1,493	1,493
	買建	6,369	4,063	1,521	1,521
	合計			797	797

- (注) 1. 上記取引については時価評価を行い、評価損益を連結損益計算書に計上しております。
 なお、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
 取引対象物の価格、契約期間等の構成要素に基づき算定しております。
3. 商品はオイル及び金属に係るものであります。

(6)クレジットデリバティブ取引

(金額単位 百万円)

区分	種 類	当連結会計年度(平成15年3月31日現在)			
		契約額等		時 価	評 価 損 益
		うち1年超			
店頭	クレジットデフォルトオプション				
	売建	39,823	22,790	1,767	1,767
	買建	35,625	18,592	3,153	3,153
	その他				
	売建	5,722	1,099	4,915	4,915
	買建	86,567	79,546	276	276
	合計			6,578	6,578

- (注) 1. 上記取引については時価評価を行い、評価損益を連結損益計算書に計上しております。
 なお、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
 取引対象物の価格、契約期間等の構成要素に基づき算定しております。
3. 「売建」は信用リスクの引受取引、「買建」は信用リスクの引渡取引であります。

2.前連結会計年度(平成14年3月31日現在)

(注)前連結会計年度には、旧わかしお銀行を連結子会社とする旧三井住友銀行の計数を表示しています。

(1)金利関連取引

(金額単位 百万円)

区分	種類	前連結会計年度(平成14年3月31日現在)			
		契約額等	うち1年超	時価	評価損益
取引所	金利先物				
	売建	8,943,374	542,286	3,429	3,429
	買建	6,928,597	341,900	3,190	3,190
	金利オプション				
店	売建	574,331	-	22	22
	買建	701,914	-	48	48
店頭	金利先渡契約				
	売建	9,174,207	580,000	13	13
	買建	3,024,390	780,000	248	248
	金利スワップ	268,046,524	169,004,153	37,188	37,188
	受取固定・支払変動	128,429,893	79,655,118	2,593,978	2,593,978
	受取変動・支払固定	124,541,252	76,679,066	2,548,948	2,548,948
	受取変動・支払変動	14,722,791	12,361,681	5,459	5,459
	スワップション				
	売建	1,118,152	523,065	21,895	21,895
	買建	952,425	592,115	19,321	19,321
	キャップ				
	売建	5,446,040	4,319,041	7,950	7,950
	買建	4,622,975	3,586,333	11,040	11,040
	フロアー				
	売建	400,233	235,877	9,240	9,240
	買建	621,113	325,744	12,622	12,622
その他					
売建	14,352	13,852	9,170	9,170	
買建	188,333	62,889	2,390	2,390	
	合計			34,335	34,335

- (注) 1. 上記取引については時価評価を行い、評価損益を連結損益計算書に計上しております。
 なお、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。
 また、一部の在外連結子会社において、現地の会計基準に従って処理している金利関連取引は、上記記載から除いております。なお、この未実現損益は490百万円(利益)であります。
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

(金額単位 百万円)

区分	種類	前連結会計年度(平成14年3月31日現在)			
		契約額等	うち1年超	時価	評価損益
店頭	通貨スワップ	15,732,720	8,809,028	46,698	46,698
	為替予約	1,319,768	336,625	2,439	2,439
	通貨オプション				
	売建	11,641	2,362	877	877
店	買建	10,956	4,209	931	931
	その他				
店頭	売建	293,341	293,341	3,163	3,163
	買建	457,727	457,727	6,145	6,145
	合計			46,102	46,102

- (注) 1. 上記取引については時価評価を行い、評価損益を連結損益計算書に計上しております。
 なお、ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引及び下記注3.の取引は、上記記載から除いております。
 また、一部の在外連結子会社において、現地の会計基準に従って処理している通貨関連取引は、上記記載から除いております。なお、この未実現損益は715百万円(利益)であります。
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. 先物為替予約、通貨オプション等のうち、連結会計年度末日に引直しを行い、その損益を連結損益計算書に計上しているもの、及び外貨建金銭債権債務等に付されたもので当該外貨建金銭債権債務等の連結貸借対照表表示に反映されているもの又は当該外貨建金銭債権債務等が連結手続上消去されたものについては、上記記載から除いております。
引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。

(金額単位 百万円)

区分	種 類	前連結会計年度 (平成14年3月31日現在)	
		契 約 額 等	
取引所	通貨先物		
	売建		-
	買建		-
	通貨オプション		
	売建		-
	買建		-
店頭	為替予約	42,123,544	
	通貨オプション		
	売建	3,161,699	
	買建	3,736,356	

(3) 株式関連取引

(金額単位 百万円)

区分	種 類	前連結会計年度 (平成14年3月31日現在)			
		契 約 額 等	うち1年超	時 価	評 価 損 益
取引所	株式指数先物				
	売建	55	-	0	0
	買建	211	-	0	0
	株式指数オプション				
	売建	-	-	-	-
	買建	-	-	-	-
店頭	有価証券店頭オプション				
	売建	-	-	-	-
	買建	-	-	-	-
	有価証券店頭指数等スワップ				
	株価指数変化率受取・ 短期変動金利支払	-	-	-	-
	短期変動金利受取・ 株価指数変化率支払	11,664	-	25	25
その他					
売建	98,375	21,566	4,531	4,531	
買建	69,016	-	796	796	
	合計			3,709	3,709

- (注) 1. 上記取引については時価評価を行い、評価損益を連結損益計算書に計上しております。
なお、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、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。

(4) 債券関連取引

(金額単位 百万円)

区分	種類	前連結会計年度(平成14年3月31日現在)			
		契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
取引所	債券先物				
	売建	13,300	-	78	78
	買建	13,300	-	90	90
	債券先物オプション				
	売建	-	-	-	-
買建	5,000	-	11	11	
店頭	債券店頭オプション				
	売建	23,064	17,384	11	11
	買建	28,155	4,953	0	0
	合計			11	11

- (注) 1. 上記取引については時価評価を行い、評価損益を連結損益計算書に計上しております。
 なお、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。

(5) 商品関連取引

(金額単位 百万円)

区分	種類	前連結会計年度(平成14年3月31日現在)			
		契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
店頭	商品スワップ				
	固定価格受取・ 変動価格支払	1,918	1,796	504	504
	変動価格受取・ 固定価格支払	1,918	1,796	361	361
	商品オプション				
	売建	5,026	4,469	1,070	1,070
	買建	5,026	4,469	1,107	1,107
	合計			180	180

- (注) 1. 上記取引については時価評価を行い、評価損益を連結損益計算書に計上しております。
 なお、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
 取引対象物の価格、契約期間等の構成要素に基づき算定しております。
3. 商品はオイルに係るものであります。

(6) クレジットデリバティブ取引

(金額単位 百万円)

区分	種類	前連結会計年度(平成14年3月31日現在)			
		契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
店頭	クレジット・デフォルト・オプション				
	売建	51,166	43,807	774	774
	買建	49,684	37,903	1,428	1,428
	その他				
	売建	16,354	14,514	2,584	2,584
買建	223,044	80,496	14,895	14,895	
	合計			12,965	12,965

- (注) 1. 上記取引については時価評価を行い、評価損益を連結損益計算書に計上しております。
 なお、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
 取引対象物の価格、契約期間等の構成要素に基づき算定しております。
3. 「売建」は信用リスクの引受取引、「買建」は信用リスクの引渡取引であります。