

# デリバティブ取引情報(単体)

## デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益

### (1) 金利関連取引

(単位:百万円)

区分	種類	平成11年3月末				平成12年3月末			
		契約額等	うち1年超	時価	評価損益	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
取引所	金利先物								
	売建	11,016,657	442,222	11,016,508	148	11,123,048	52,429	11,074,094	48,953
	買建	9,938,964	416,412	9,941,766	2,802	10,099,803	—	10,058,766	41,036
	金利オプション								
	売建								
	コール	—	—	—	—	—	—	—	—
	プット	(—)	—	—	—	(—)	—	—	—
	買建								
	コール	(—)	—	—	—	(—)	—	—	—
	プット	(—)	—	—	—	(—)	—	—	—
店頭	金利先渡契約								
	売建	—	—	—	—	2,160	—	2,111	49
	買建	—	—	—	—	1,506	—	1,510	4
	金利スワップ	59,802,624	32,473,894	110,454	110,454	46,866,089	21,196,115	134,659	134,659
	<sup>※</sup> 受取固定・支払変動	31,737,241	17,824,178	707,457	707,457	27,161,214	10,919,967	493,913	493,913
	<sup>※</sup> 受取変動・支払固定	27,456,355	14,087,370	597,043	597,043	18,896,376	9,547,954	358,684	358,684
	<sup>※</sup> 受取変動・支払変動	191,420	162,845	100	100	460,676	380,370	397	397
	<sup>※</sup> 受取固定・支払固定	417,606	399,500	59	59	—	—	—	—
	スワップション								
	売建								
	コール	180,187	76,700	—	—	98,150	48,200	—	—
	(4,670)			1,366	3,304	(3,309)		956	2,353
	プット	3,297	—	80	80	2,546	—	88	88
	(—)					(—)			
	買建								
	コール	58,927	15,240	30	1,308	16,000	8,000	4	258
	(1,338)					(262)			
	プット	3,297	—	80	80	2,546	—	68	68
	(—)					(—)			
	キャップ								
売建	18,444	18,444	18	188	20,732	16,658	329	281	
(206)					(47)				
買建	221,230	173,321	822	1,224	248,435	199,907	1,126	786	
(2,047)					(1,913)				
フロアー									
売建	53,920	44,009	1,826	704	55,026	47,088	2,025	481	
(1,121)					(1,543)				
買建	14,102	14,102	33	25	2,054	1,031	10	5	
(7)					(5)				
その他									
売建	6,027	—	13	13	—	—	—	—	
(—)					(—)				
買建	6,027	—	13	13	—	—	—	—	
(—)					(—)				
合計				113,686				143,202	

(注)1. 時価の算定

取引所取引については、東京金融先物取引所等における最終の価格によっています。

店頭取引については、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います。

2. ( )内は貸借対照表に計上したオプション料です。

3. 平成12年3月末における金利スワップの時価及び評価損益には、貸借対照表及び損益計算書に計上した経過利息部分の206,145百万円が含まれています。

なお、平成11年3月末については、114ページの(参考)をご参照ください。

4. スワップションにおけるコール/プットは、次の定義によっています。

コール：受取変動・支払固定の金利スワップを取り組む権利

プット：受取固定・支払変動の金利スワップを取り組む権利

(補足)金利スワップ契約の内容

(単位:百万円)

残存期間	平成11年3月末			平成12年3月末		
	1年内	1年超5年以内	5年超	1年内	1年超5年以内	5年超
金利スワップ想定元本合計	27,328,729	27,943,971	4,529,922	25,669,974	17,953,048	3,243,067
うち受取固定・支払変動	13,913,063	15,725,534	2,098,643	16,241,246	9,503,708	1,416,259
うち受取変動・支払固定	13,368,985	11,701,223	2,386,146	9,348,421	7,736,978	1,810,976
うち受取変動・支払変動	28,575	156,104	6,740	80,306	364,539	15,831
うち受取固定・支払固定	18,106	361,108	38,391			

5. 特定取引(トレーディング取引)に含まれるデリバティブ取引については、時価評価を行い、その評価損益を損益計算書に計上していますので前記記載から除いています。

特定取引に含まれるデリバティブ取引の契約額等は下記のとおりです。

(単位:百万円)

区分	種類	平成11年3月末		平成12年3月末	
		契約額等	時価	契約額等	時価
取引所	金利先物				
	売建	1,202,922	1,204,249	371,934	371,867
	買建	1,218,583	1,219,787	713,795	713,606
	金利オプション				
	売建				
	コール	—	—	—	—
	プット	(—)	—	(—)	—
	買建	(4)	—	(—)	—
	コール	—	—	—	—
	プット	(—)	—	(—)	—
店頭	金利先渡契約				
	売建	2,366,290	2,366,018	143,819	143,728
	買建	2,480,704	2,480,470	98,036	97,921
	金利スワップ	91,763,598	3,901	92,446,012	20,137
	うち受取固定・支払変動	47,477,505	536,971	47,862,973	402,815
	うち受取変動・支払固定	43,198,593	539,714	42,329,038	418,574
	うち受取変動・支払変動	1,075,500	1,157	2,254,000	4,378
	うち受取固定・支払固定	12,000	0		
	スワップション				
	売建				
	コール	128,950		115,600	
	プット	(2,108)	936	(1,495)	748
	買建	142,110	5,672	164,250	2,361
	コール	(1,872)		(1,623)	
	プット	283,800	269	118,000	143
	コール	(4,129)		(2,841)	
	プット	120,500	1,724	138,000	906
コール	(572)		(555)		
キャップ					
売建	1,707,095	4,226	1,927,469	6,200	
買建	(17,151)	4,293	(15,723)	4,652	
売建	1,220,923		1,157,066		
買建	(9,110)		(7,413)		
フロアー					
売建	1,700	11	800	10	
買建	(1)	2,340	(3)		
売建	49,097		82,651		
買建	(1,124)		(1,706)	2,869	
その他					
売建	13,000	79	20,950	42	
買建	(280)	41	(349)		
売建	13,000		13,000		
買建	(18)		(—)	29	

(注) ( )内は契約額等に係る当初の受払オプション料です。

## (2) 通貨関連取引

(単位:百万円)

区分	種類	平成11年3月末				平成12年3月末			
		契約額等	うち1年超	時価	評価損益	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
店頭	通貨スワップ	3,929,602	2,010,182	12,628	12,628	2,807,371	1,509,916	544	544
	うち米ドル	2,928,668	1,596,034	15,112	15,112	2,163,302	1,224,548	622	622
	うち仏フラン	242,752	5,119	231	231	—	—	—	—
	うち香港ドル	365,716	102,405	1,583	1,583	—	—	—	—
	うち英ポンド	78,577	74,286	2,356	2,356	86,458	59,235	1,216	1,216
	うちユーロ	—	—	—	—	5,043	—	15	15
	その他	313,886	232,336	3,488	3,488	552,566	226,131	65	65

(注)1. 時価の算定

割引現在価値により算定しています。

2. 平成12年3月末における通貨スワップの時価及び評価損益には、貸借対照表及び損益計算書に計上した経過利息部分の8,137百万円が含まれています。なお、平成11年3月末については、114ページの(参考)をご参照ください。

3. 特定取引(トレーディング取引)に含まれるデリバティブ取引については、時価評価を行い、その評価損益を損益計算書に計上していますので上記記載から除いています。

特定取引に含まれるデリバティブ取引の契約額等は下記のとおりです。

(単位:百万円)

区分	種類	平成11年3月末		平成12年3月末	
		契約額等	時価	契約額等	時価
店頭	通貨スワップ	852,213	9,361	773,713	1,585
	うち米ドル	819,977	10,241	716,748	1,276
	うちユーロ	—	—	8,067	39
	うちスイスフラン	—	—	3,171	200
	うち独マルク	1,323	39	—	—
	その他	30,912	918	45,725	68

4. 先物為替予約、通貨オプション等については、期末日に引直しを行い、その損益を損益計算書に計上していますので上記記載から除いています。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す。

(単位:百万円)

区分	種類	平成11年3月末	平成12年3月末
		契約額等	契約額等
取引所	通貨先物		
	売建	—	—
	買建	—	—
	通貨オプション		
	売建		
	コール	—	—
		(—)	(—)
	プット	—	—
		(—)	(—)
	買建		
コール	—	—	
	(—)	(—)	
プット	—	—	
	(—)	(—)	
店頭	為替予約	61,110,005	41,647,002
	通貨オプション		
	売建	932,721	1,179,988
		(14,589)	(14,341)
	買建	826,094	964,387
		(21,169)	17,199
	その他		
売建	—	—	
買建	—	—	

(注)( )内は貸借対照表に計上したオプション料です。

(3) 株式関連取引

(単位:百万円)

区分	種類	平成11年3月末				平成12年3月末			
		契約額等	うち1年超	時価	評価損益	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	—	—	—	—	—	—	—	—
	買建	—	—	—	—	—	—	—	—
	株式指数オプション								
	売建								
	コール	—	—	—	—	—	—	—	—
	プット	(—)	—	—	—	(—)	—	—	—
	買建	(—)	—	—	—	(—)	—	—	—
	コール	—	—	—	—	—	—	—	—
	プット	(—)	—	—	—	(—)	—	—	—
店頭	有価証券店頭オプション								
	売建								
	コール	( )				( )			
	プット	( )				( )			
	買建								
	コール	( )				( )			
	プット	( )				( )			
	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								
	株価指数変化率支払・ 短期変動金利受取								
その他									
売建	(—)		—	—	(—)		—	—	
買建	(—)		—	—	58 (22)	—	9	13	
合計				—				13	

(注) 1. 時価の算定

取引所取引については、東京証券取引所等における最終の価格によっています。

店頭取引については、割引現在価値やオプション価格計算モデル等により算出しています。

2.( )内は貸借対照表に計上したオプション料です。

3. 特定取引(トレーディング取引)に含まれるデリバティブ取引については、時価評価を行い、その評価損益を損益計算書に計上していますので前記記載から除いています。

特定取引に含まれるデリバティブ取引の契約額等は下記のとおりです。

(単位:百万円)

区分	種類	平成11年3月末		平成12年3月末	
		契約額等	時価	契約額等	時価
取引所	株式指数先物				
	売建				
	買建				
	株式指数オプション				
	売建				
	コール	( )		( )	
プット	( )		( )		
買建					
コール	( )		( )		
プット	( )		( )		
店頭	有価証券店頭オプション				
	売建				
	コール	( )		( )	
	プット	( )		( )	
	買建				
	コール	( )		( )	
プット	( )		( )		
	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				
	株価指数変化率支払・ 短期変動金利受取				
	その他				
	売建				
	買建				

(注) ( )内は契約額等に係る当初の受払オプション料です。

## (4) 債券関連取引

(単位:百万円)

区分	種類	平成11年3月末				平成12年3月末			
		契約額等	うち1年超	時価	評価損益	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
取引所	債券先物								
	売建	30,830	—	30,980	149	416,719	—	419,622	2,902
	買建	5,136	—	5,108	27	47,866	—	48,035	168
	債券先物オプション								
	売建								
	コール	—	—	—	—	—	—	—	—
	プット	(—)	—	—	—	(—)	—	—	—
	買建	(—)	—	—	—	(—)	—	—	—
	コール	—	—	—	—	—	—	—	—
	プット	(—)	—	—	—	(—)	—	—	—
店頭	債券店頭オプション								
	売建								
	コール	—	—	—	—	—	—	—	—
	プット	(—)	—	—	—	(—)	—	—	—
	買建	(—)	—	—	—	(—)	—	—	—
	コール	—	—	—	—	—	—	—	—
	プット	(—)	—	—	—	(—)	—	—	—
	その他								
	売建	—	—	—	—	—	—	—	—
	買建	—	—	—	—	—	—	—	—
合計				177				2,734	

(注)1. 時価の算定

取引所取引については、東京証券取引所等における最終の価格によっています。

店頭取引については、オプション価格計算モデル等により算定しています。

2. ( )内は貸借対照表に計上したオプション料です。

3. 特定取引(トレーディング取引)に含まれるデリバティブ取引については、時価評価を行い、その評価損益を損益計算書に計上していますので前記記載から除いています。

特定取引に含まれるデリバティブ取引の契約額等は下記のとおりです。

(単位:百万円)

区分	種類	平成11年3月末		平成12年3月末	
		契約額等	時価	契約額等	時価
取引所	債券先物				
	売建	9,661	9,675	6,548	6,575
	買建	115,837	116,458	4,804	4,862
	債券先物オプション				
	売建				
	コール	—	—	—	—
	プット	(—)	—	(—)	—
	買建				
	コール	—	—	—	—
	プット	(—)	—	(—)	—
店頭	債券店頭オプション				
	売建				
	コール	—	—	—	—
	プット	(—)	—	(—)	—
	買建				
	コール	—	—	—	—
	プット	(—)	—	(—)	—
	その他				
	売建	—	—	—	—
	買建	—	—	—	—

(注)( )内は契約額等に係る当初の受払オプション料です。

## (5)商品関連取引

商品関連取引には該当ありません。

## (6)クレジットデリバティブ取引

特定取引以外の取引は保証に準じた取引であり、記載対象から除いています。

特定取引には該当ありません。

(参考)平成11年3月末におけるトレーディング取引以外のスワップ(金利スワップ及び通貨スワップ)の時価及び評価損益には、損益計上している経過利息部分の108,510百万円が含まれています。

従って、スワップ(金利スワップ及び通貨スワップ)の時価及び評価損益として記載している97,826百万円のうち、未実現損益相当額は、この経過利息部分を控除した10,684百万円(損失)となります。

なお、平成12年3月末については、108ページの(注)3及び110ページの(注)2をご参照ください。